

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成31年2月5日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド（愛称：賢者のセオリー）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(3) 【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

2019年2月6日から2019年8月2日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受け付けは、行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

委託会社の各営業日()の午後3時までには受付けた取得および換金の申込み(当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを)、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎで行なわれる申込みは、翌営業日()の取扱いとなります。

()前 の申込受付中止日を除きます。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします(以下同じ。)。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、商品先物）））
	決算頻度	年6回（隔月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年6回（隔月）」…目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファンド・オブ・ファンズ」…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ

- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (含む日本)		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		
債券	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合・資産配分固定 型(株式、債券、商品先物)))	日々	オセアニア		
資産複合 ()	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産配分固定型 資産配分変更型		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ(アドレス <http://www.toushin.or.jp/>)をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

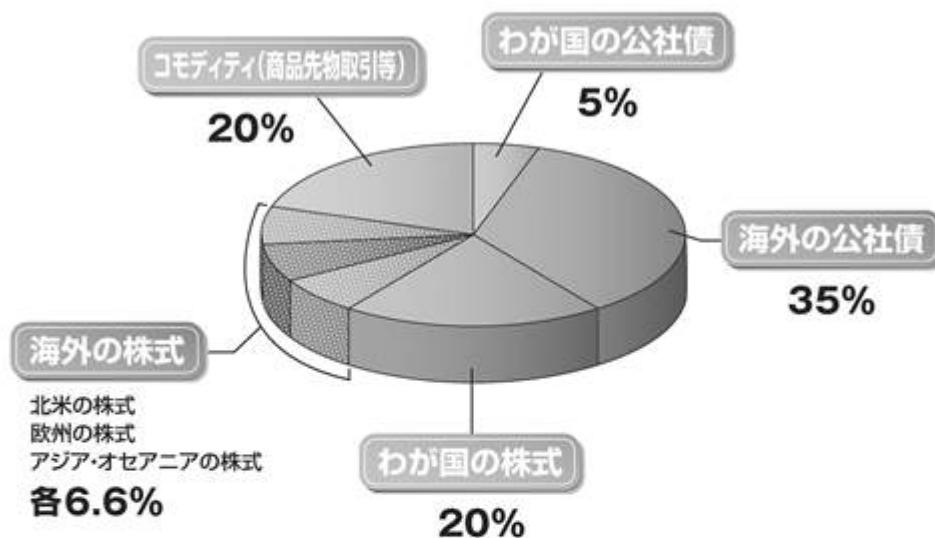
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

●当ファンドは、以下の7本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

■ 投資対象ファンド

- ①ダイワ日本国債マザーファンド
- ②ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
- ③ダイワ好配当日本株マザーファンド
- ④ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ⑤ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ⑥ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ⑦ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa "RICI" Fund」(以下「ダイワ "RICI" ファンド」といいます。)(米ドル建て)

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の7本の投資信託証券への投資を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資します。



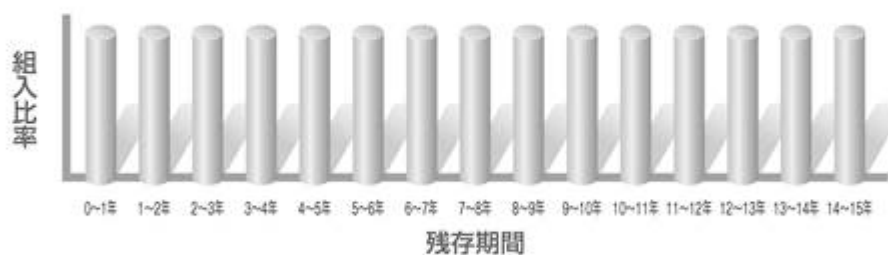
※くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

2

わが国の国債への投資にあたっては、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3 海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

※「ソブリン債等」とは、国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債などをいいます。

- ドル通貨圏（米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等）、欧州通貨圏（ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等）の2つの通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。
- ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

※欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。

（注）上記はイメージであり、実際の投資割合が上記のとおりとなるとは限りません。

- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上^{※1}、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上^{※2}とすることを基本とします。

債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	S&Pの場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1, Aa2, Aa3 }	AA { AA+, AA, AA- }
	A { A1, A2, A3 }	A { A+, A, A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
低い	C	C
		D

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ (Moody's) やS&Pグローバル・レーティング (S&P) といった格付会社が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

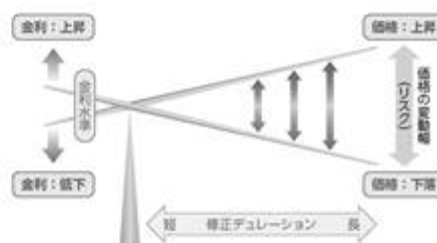
※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

- ポートフォリオの修正デュレーションは5 (年) 程度から10 (年) 程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

- 修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。
- 修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動（ブレ幅）が大きくなります。

金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ）



- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

4 わが国の株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。

投資対象のイメージ



※配当利回り：株式投資を行なう際に用いられる株式の投資価値を測る指標のひとつです。個別銘柄の配当利回りから株価の割安度の測定や、株式市場全体の配当利回りと市場金利を比較して、株価水準の妥当性の測定などを行なうことができます。

$$\text{配当利回り (\%)} = (\text{1株当たり年間配当金} \div \text{株価}) \times 100$$

銘柄選定プロセス



5 海外の株式への投資にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成

(イメージ)



投資対象のイメージ



- ◆北米の株式の運用は、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

- ◆北米の株式への投資にあたっては、株式のほかハイブリッド優先証券*を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

- ・株式と債券の両方の性質を併せ持った証券です。
- ・弁済順位は、株式と債券の中間の位置付けとなります。

〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・優先証券や大型バリュー株などインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- ・リート運用では最大級の資産規模。
- ・ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- ・所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

- ◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

アムンディ・アイルランド・リミテッドは、運用資産額で欧州および世界でトップクラスに入るフランスの資産運用会社アムンディ・グループの主要運用拠点のひとつで、アイルランド（ダブリン市）に所在します。

6 コモディティ（商品先物取引等）への投資にあたっては、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動することをめざします。

- ダイワ“RICI”ファンドの信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。

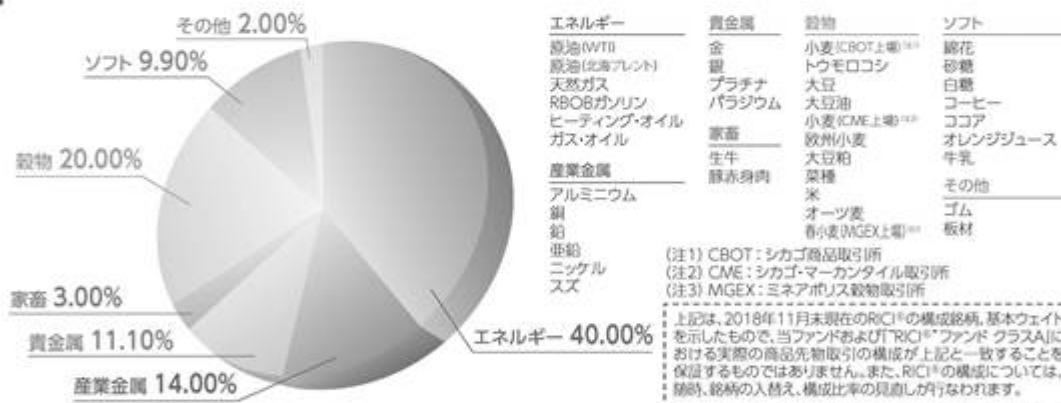
コモディティとは…

コモディティとは身近にあるさまざまな製品の原材料になるもので、主要な品目としては、原油や天然ガスなどの「エネルギー」、金・銀や銅・アルミニウムなどの「金属」、そして小麦・トウモロコシや生牛・豚赤身肉などの「農畜産物」などがあり、一般的に商品先物取引所に上場されています。



（注）上記のコモディティはあくまでも一例であり、他にもヒーティング・オイル、プラチナ、ニッケル、大豆、砂糖などがあります。

RICI構成比率および構成銘柄（2018年11月末現在）



〈RICI（ロジャーズ国際コモディティ指数）について〉

- ・RICIは、世界中の経済活動に広く利用されているコモディティ（商品）の値動きを表します。
- ・RICIは、38種類（2018年11月末現在）の商品先物で構成される指数です。
- ・RICIは、1998年8月より計算および公表を行なっております。
- ・RICIを構成する品目とその比率は、ジム・ロジャーズが議長をつとめるRICI委員会において、各品目の需要見通しおよび先物市場の流動性等を勘案して決定されます。
- ・RICIは、投資可能性を考慮に入れた実用性の高い指数です。

「RICI構成比率および構成銘柄」の変更については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

【注記】

【ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド（愛称：賢者のセオリー）】およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。）はJames Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc.（以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。）により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Indexの決定、構成、算出において大和証券投資信託委託株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。[Jim Rogers]、[Rogers International Commodity Index] および [RICI] は、James Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc.のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

・保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～6.の運用が行なわれないことがあります。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まる場合があります。

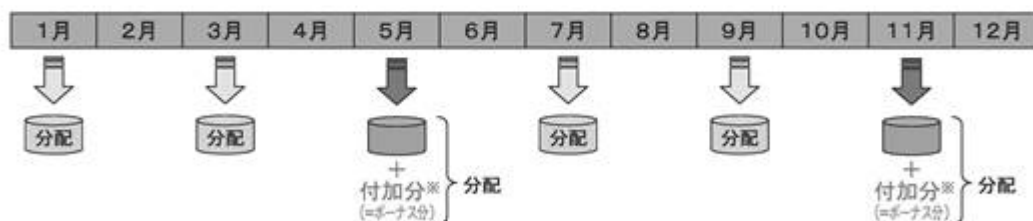
7

毎年1、3、5、7、9、11月の各10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
 - ②原則として、配当等収益等を中心に継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわない場合があります。
- なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1万口当たり。以下同じ。）が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合…500円を上限とします。
 - ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合…1,000円を上限とします。

収益分配のイメージ



※5月と11月の付加額は、ゼロの場合があります。

- ◆上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- ◆分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ◆ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

投資対象ファンドの概要

I. ダイワ日本国債マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	わが国の国債を投資対象とし、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
投資態度	①主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。 ②わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。 ③国債の組入れは原則として高位を保ちます。 ④運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
信託期間	無期限（2005年3月29日当初設定）
決算日	毎年3月10日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

Ⅱ. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	<p>①主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>②海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。</p> <p>イ、米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。</p> <p>※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ ※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等</p> <p>ロ、ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします(ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。)</p> <p>ハ、国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。</p> <p>ニ、ポートフォリオの修正デュレーションは5(年)程度から10(年)程度の範囲を基本とします。</p> <p>ホ、金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建の国債先物取引等を利用することがあります。</p> <p>③為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。</p>
信託期間	無期限(2005年4月26日当初設定)
決算日	毎年4月10日および10月10日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

Ⅲ. ダイワ好配当日本株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	①主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。 ②株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。
信託期間	無期限(2005年7月11日当初設定)
決算日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

Ⅳ. ダイワ北米好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	①主として、北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ⑤保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
信託期間	無期限(2005年10月28日当初設定)
決算日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

V. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	<p>①主として、欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>②銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。</p> <p>③外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。</p> <p>④株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>⑤保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。</p>
信託期間	無期限（2005年10月28日当初設定）
決算日	毎年4月15日および10月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

Ⅵ. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	①主として、アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
信託期間	無期限（2005年10月28日当初設定）
決算日	毎年4月15日および10月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

【各マザーファンド共通】

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

Ⅶ. ダイワ "RICI" ファンド

形態／表示通貨	ケイマン籍の外国証券投資信託／米ドル建て
運用目的	当ファンドは、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数("RICI")に連動することをめざします。
投資方針	<p>①信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数("RICI")に連動する投資成果をめざします。</p> <p>②米ドル建て短期公社債等への投資にあたっては、主に1年以内に償還を迎える米ドル建て短期公社債等に投資します。また、投資対象には、銀行引受手形、預託証書、コマーシャル・ペーパー、定期預金証書などへの投資も含まれますが、これに限定いたしません。</p> <p>③信託財産の純資産総額の50%未満の部分で商品先物取引および商品先渡取引に投資します。</p> <p>④当ファンドの純資産に占める、商品先物取引および商品先渡取引等の証拠金の割合はおおよそ10-30パーセントの範囲で行ないます。(また、最大でも、純資産の50%以下とします。)</p> <p>⑤大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用が行なわれない場合があります。</p> <p>⑥当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
関係法人	<p>管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービシズ・リミテッド(ケイマン)</p> <p>受託会社：G.A.S.(ケイマン)リミテッド</p> <p>運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド</p> <p>資産保管会社：SMT Trustees (Ireland) Limited</p> <p>管理事務代行会社：SMT Fund Services (Ireland) Limited</p> <p>管理会社代行サービス会社：大和証券投資信託委託株式会社</p>
報酬等	<p>信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額</p> <p>管理報酬等：0.415% (管理会社代行サービス報酬を含みます。)</p> <p>受託報酬等：0.175% (管理事務代行報酬および資産保管会社の報酬を含みます。)</p> <p>運用報酬等：0.41%</p> <p>合計：1.00%</p> <p>その他、外国投資信託に関する租税、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。</p>
設定日	2006年11月13日
決算日	毎年4月30日

【収益分配金に関する留意事項】

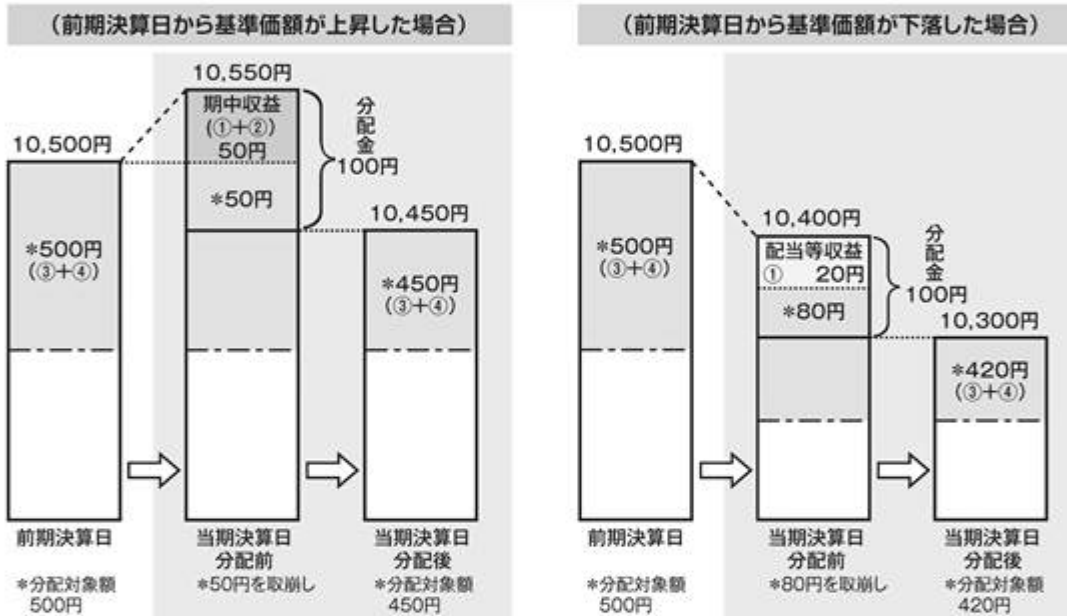
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)



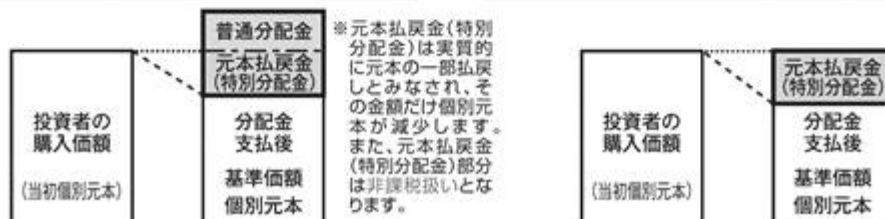
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)

(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

(2) 【ファンドの沿革】

2006年11月10日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
-------	------	--

1

収益分配金、償還金など お申込金(5)

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
------	----------------	---

運用指図

2

損益 信託金(5)

受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
------	--	--

損益 投資

投資対象	<p>投資対象ファンドの受益証券 など</p> <p>(ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、それぞれコーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク、アムンディ・アイルランド・リミテッド(投資顧問会社)(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します。)</p>
------	---

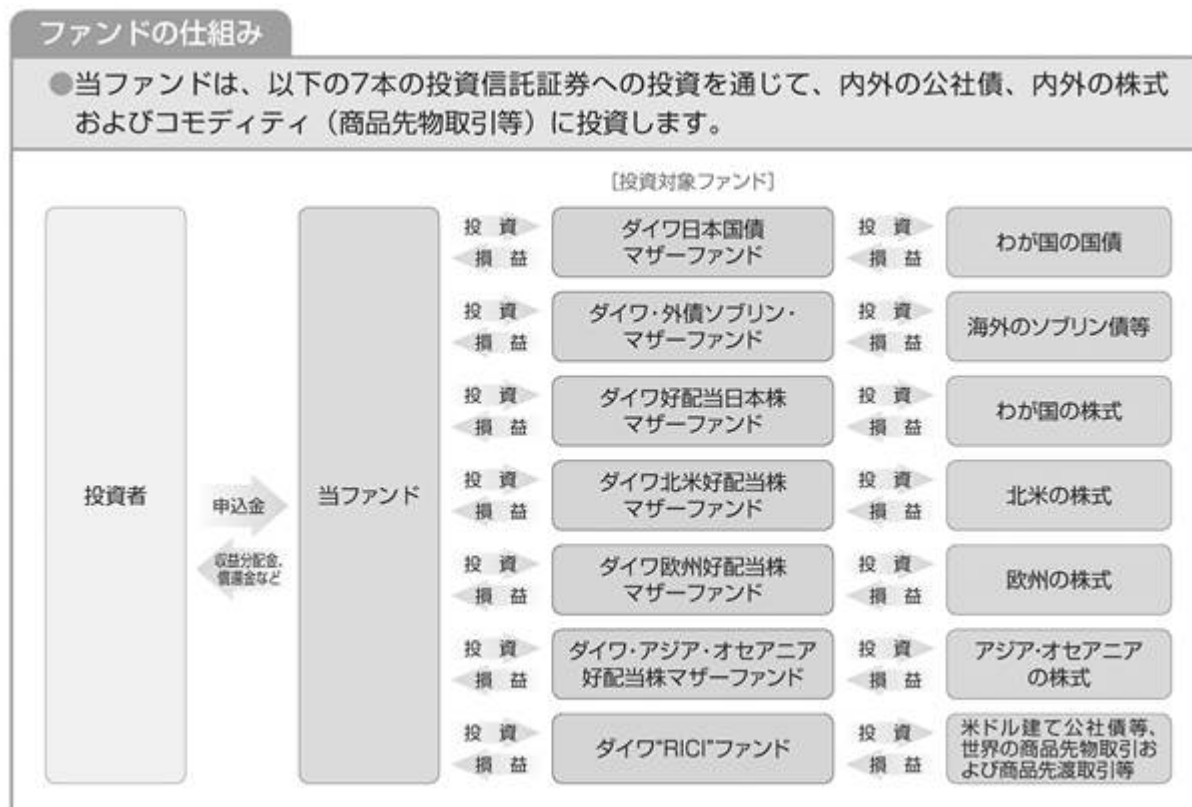
(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

(注2)投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約(3)に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます(4)。

- 1: 受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2: 「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。

- 3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。



< 委託会社の概況（2018年11月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

- | | |
|-------------|--|
| 1959年12月12日 | 設立登記 |
| 1960年 2月17日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得 |
| 1960年 4月 1日 | 営業開始 |
| 1985年11月 8日 | 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。 |
| 1995年 5月31日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。 |
| 1995年 9月14日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。 |
| 2007年 9月30日 | 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号) |

・大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

下記の各ファンド(1.から6.までに掲げるファンドを、以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。

1. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
7. ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “ RICI ” Fund」(以下「ダイワ “ RICI ” ファンド」といいます。)の受益証券(米ドル建)

投資態度

イ. 主として複数の投資信託証券を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ(商品先物取引等)に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

ロ. 各投資信託証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券	信託財産の純資産総額の5%
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の35%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券	信託財産の純資産総額の20%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の6.6%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の6.6%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券	信託財産の純資産総額の6.6%
ダイワ “ RICI ” ファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の20%

ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まる場合があります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	ダイワ“RICI”ファンド
選定の方針	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動する投資成果をめざすファンドであること。

くわしくは「1 ファンドの性格(1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」をご参照下さい。

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から6.までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の7.に掲げる外国投資信託の受益証券、ならびに次の8.から11.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券

5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券

6. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券

7. ダイワ“RICI”ファンドの受益証券

8. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前8.の証券または証書の性質を有するもの

10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は、次のとおりです。

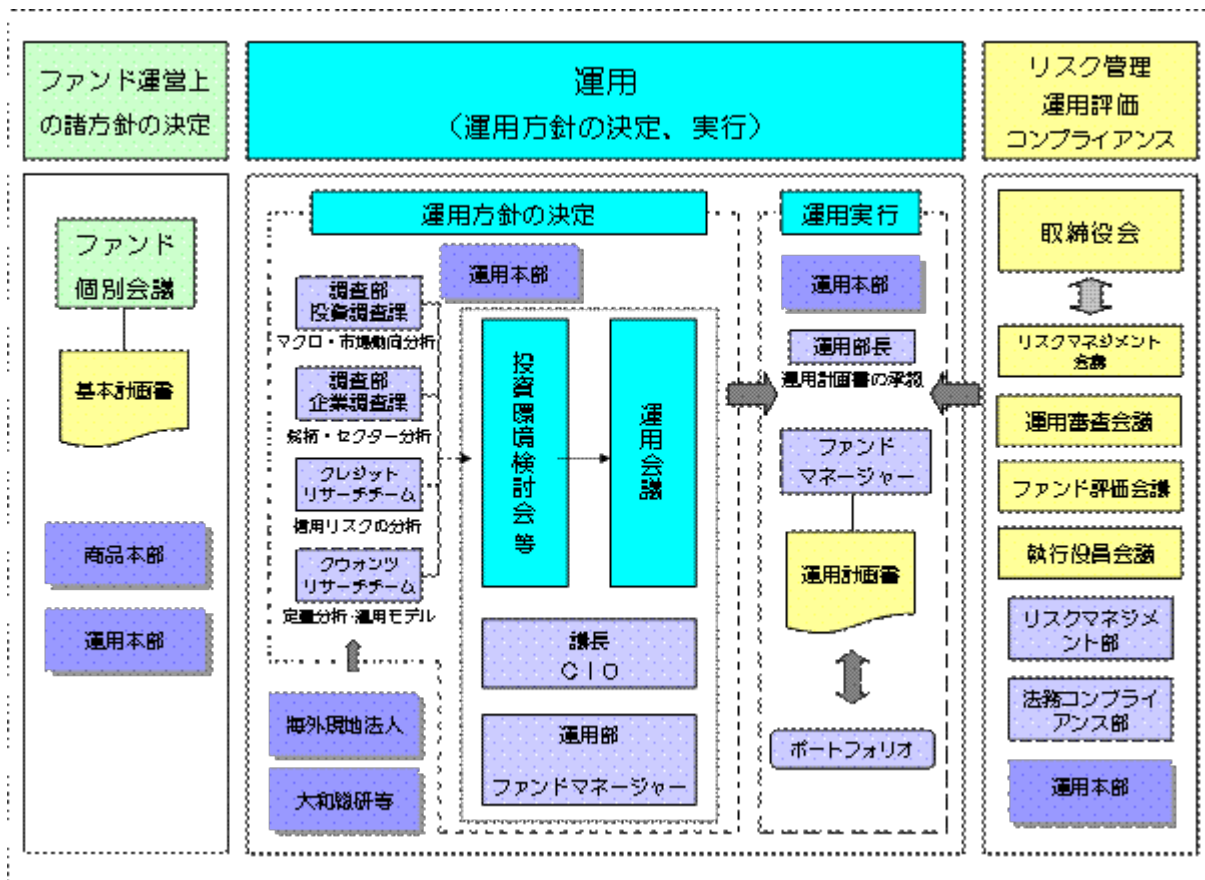
投資先ファンドの名称	ダイワ“RICI”ファンド
運用の基本方針	投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動することをめざします。
主要な投資対象	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。
委託会社の名称	管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービスズ・リミテッド（ケイマン） 運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント（シンガポール）リミテッド

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

二．執行役員会議

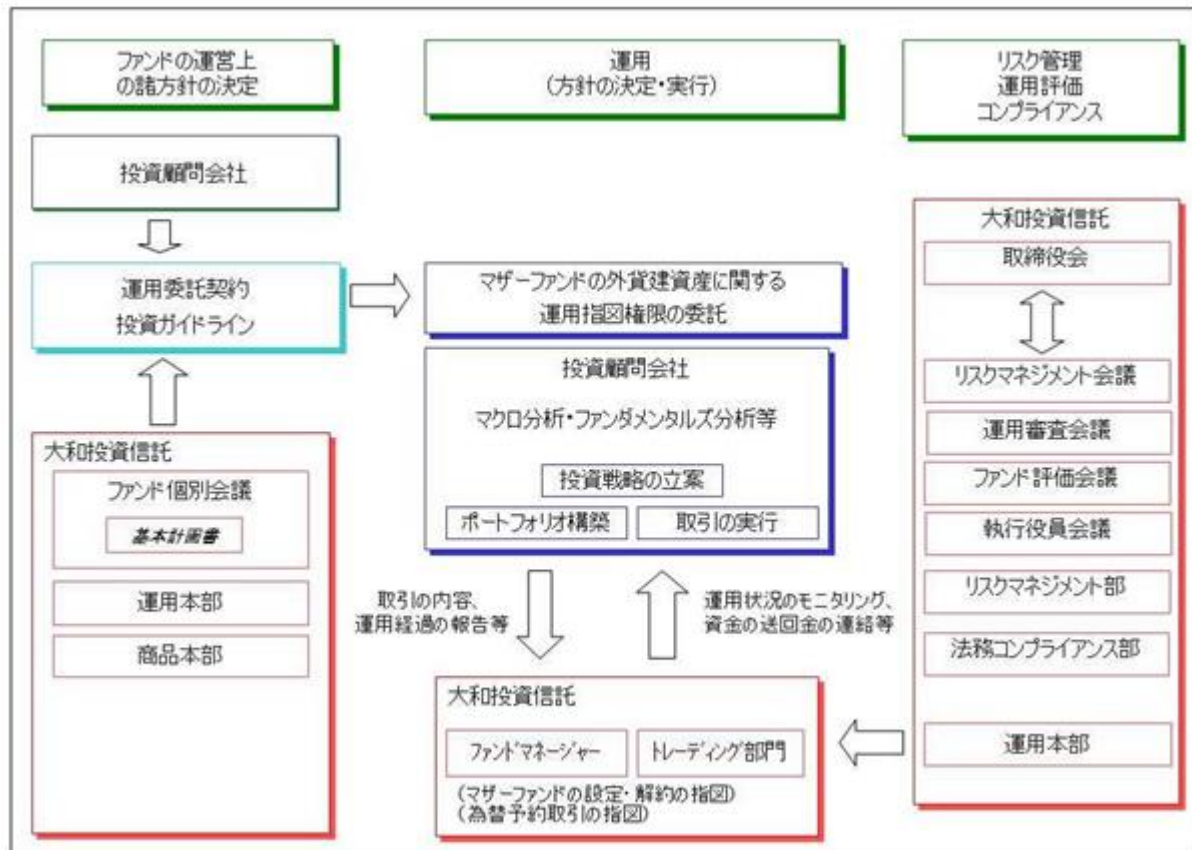
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

海外（北米）株式および海外（欧州）株式部分にかかる運用体制について

（マザーファンドにかかるものを含みます。）



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。なお、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」および「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ．運用の実行

投資顧問会社は、投資ガイドラインに基づき、投資戦略の立案、ポートフォリオ構築を行ない、取引を実行します。

ハ．モニタリング

委託会社は、投資顧問会社との間で取引の内容、運用経過の報告等を受け、資金動向等について必要な連絡を取るとともに、運用の状況、投資ガイドラインの遵守状況等をモニタリングします。

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も

行なっています。これらの報告および調査をもとに評価を行ない、委託会社でのファンド個別会議へ報告しています。

二．リスク管理、運用評価、コンプライアンス (前 に同じ。)

上記の運用体制は2018年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。

原則として、配当等収益等を中心に継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額(1万口当たり。以下「収益分配方針」において同じ。)が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。なお、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合...500円を上限とします。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合...1,000円を上限とします。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式(信託約款)

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資制限(信託約款)

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券(信託約款)

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．にかかわらず、委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券で、その約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められているものの時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超える投資の指図をすることができるものとします。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引(信託約款)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

資金の借入れ（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 投資対象ファンドについて

下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

1. ダイワ日本国債マザーファンド

主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。

償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
------	---

3. ダイワ好配当日本株マザーファンド

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

4. ダイワ北米好配当株マザーファンド

5. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

6. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
運用指図 権限の委託	<p><ダイワ北米好配当株マザーファンド> 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク New York, New York, USA 前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。</p> <p><ダイワ欧州好配当株マザーファンド> 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。 アムンディ・アイルランド・リミテッド 1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）</p> <p><ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド> 該当事項はありません。</p>
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

7. ダイワ“RICI”ファンド

「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として内外の株式、内外の公社債およびコモディティ（商品先物取引等）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

商品先物取引等による運用に伴うリスク

商品先物等の取引価格は、様々な要因（商品の需給関係の変化、天候、農業生産、貿易動向、為替レート、金利の変動、政治的・経済的事由および政策、疾病、伝染病、技術発展等）に基づき変動します（個々の品目により具体的な変動要因は異なります。）。

当ファンドでは、投資するファンドを通じて商品先物取引等による運用を行ないますので、基準価額は、商品先物ポートフォリオの構成品目の値動きの影響を受けます。

当ファンドの基準価額は、商品先物市場の変動の影響を受け、投資元本を下回ることがあります。

その他、基準価額に影響を与える要因として、次のものが考えられます。

- ・商品先物は、米ドル、カナダ・ドル、豪ドルなど各国の通貨建てで取引されるため、為替変動による影響を受けます。
- ・商品市場は、市場の流動性の不足、投機家の参入および政府の規制・介入等の様々な要因により、一時的に偏向するかその他の混乱を生じることがあります。

- ・ 各々の商品先物の上場市場が定める値幅制限(1営業日に発生する先物契約の変動額を制限する規則)などの規制・規則によって、不利な価格での契約の清算を迫られる可能性があります。
- ・ 当ファンドによる建玉が市場の一定割合を超えた場合に、取引所による建玉規制が行なわれ、指数の構成どおりに組入れができなくなる可能性があります。
- ・ 値段の低い期近の先物を値段の高い期先の先物に買換える場合、マイナスの影響を及ぼす可能性があります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カンントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となる可能性があります。

その他

- イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります(信用リスク)。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。)等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

基準価額適用日および解約代金の受渡日について原則として下記ようになります。

- ・ 当ファンドの追加設定または解約申込みに対する基準価額の適用日は申込日の翌々営業日です。
- ・ 解約申込時の解約代金の受渡日は申込日から起算して6営業日目以降です。
- ・ 当ファンドの基準価額は、組入れている投資信託証券の基準価額をもって毎営業日計算されます。

- 当ファンドの基準価額に用いる投資信託証券の基準価額は、国内資産のマザーファンドについては当日の国内マーケットが反映された当日の基準価額、外国資産のマザーファンドについては前営業日の海外マーケットが反映された当日の基準価額です。また「ダイワ“RICI”ファンド」に関しては、前々営業日の海外マーケットが反映された前営業日の基準価額です。ただし、「ダイワ“RICI”ファンド」のファンド営業日は東京証券取引所およびロンドン、ニューヨークの銀行のいずれもが営業日の日であり、いずれかの市場が休業日の場合、基準価額は算出されません。そのため、前営業日が休業日の場合、その直近のファンド営業日の基準価額を用いることとなります。

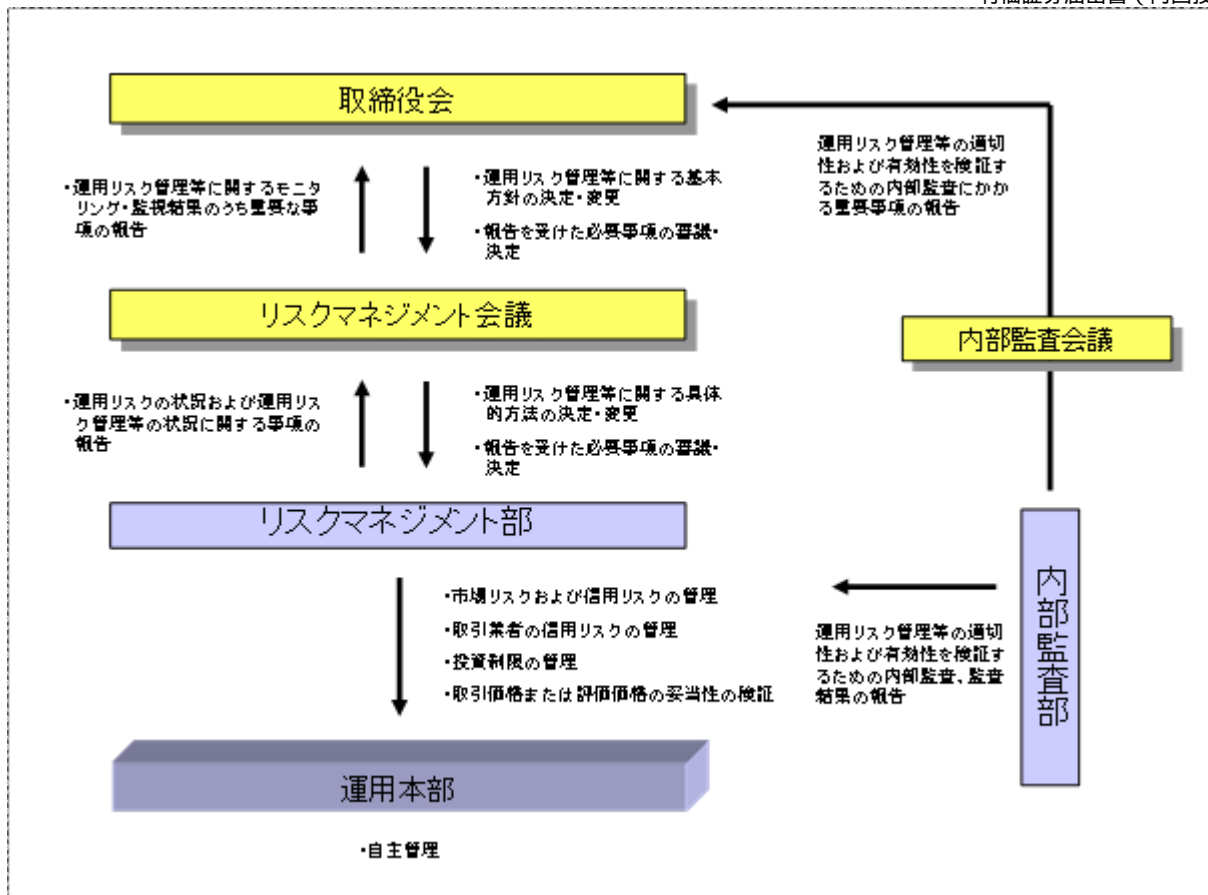


(3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

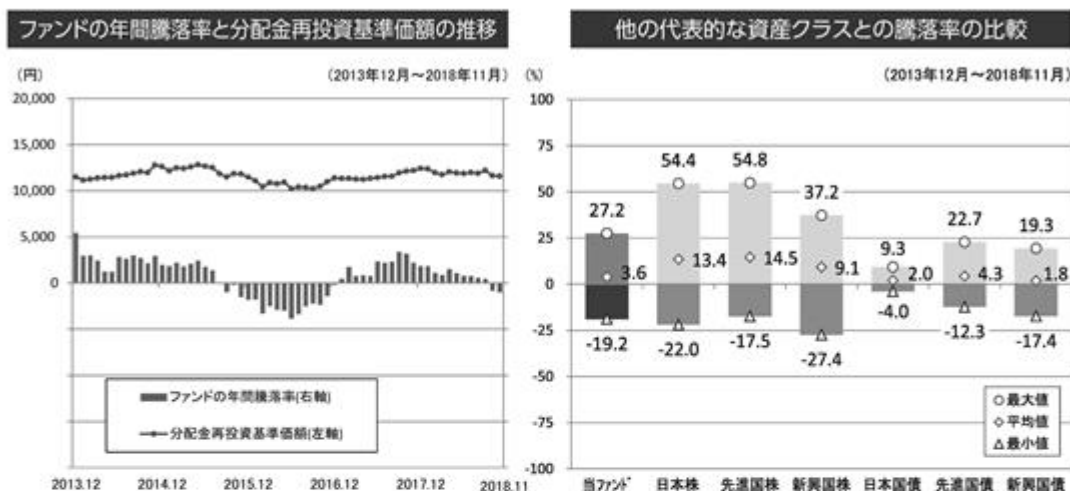


流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。



- ※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- ※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
 - ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
 - ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.458%（税抜1.35%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.65% （税抜）	年率0.65% （税抜）	年率0.05% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

委託会社は、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」および「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の各投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率1.658%（税込）程度です（当ファンドにおける実際の投資信託証券の組入状況により変動します。）。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

<投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S Aをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアN I S A」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- （ ）上記は、2018年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- （ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2018年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	238,485,192	19.34
内 ケイマン諸島	238,485,192	19.34
親投資信託受益証券	990,997,752	80.37
内 日本	990,997,752	80.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,548,824	0.29
純資産総額	1,233,031,768	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2018年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	259,559,407	1.6681 432,971,065	1.6821 436,604,878	35.41
2	ダイワ好配当日本株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	89,511,318	2.8366 253,916,406	2.7741 248,313,347	20.14
3	DAIWA RICIFUND	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	35,481.5	7,002.80 248,469,885	6,721.39 238,485,192	19.34
4	ダイワ欧州好配当株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	53,456,345	1.5963 85,332,363	1.5901 85,000,934	6.89
5	ダイワ北米好配当株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	31,733,446	2.6881 85,305,849	2.6598 84,404,619	6.85

6	ダイワ・アジア・オセアニア好配当 株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	41,793,124	1.9227 80,358,651	1.9118 79,900,094	6.48
7	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	45,281,449	1.2512 56,656,148	1.2538 56,773,880	4.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	19.34%
親投資信託受益証券	80.37%
合計	99.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5特定期間末 (2009年5月11日)	4,248,719,216	4,279,966,656	0.6791	0.6841
第6特定期間末 (2009年11月10日)	4,427,264,307	4,459,178,615	0.6923	0.6973
第7特定期間末 (2010年5月10日)	4,336,661,844	4,368,380,011	0.6836	0.6886
第8特定期間末 (2010年11月10日)	4,043,932,291	4,074,637,108	0.6585	0.6635
第9特定期間末 (2011年5月10日)	3,889,290,717	3,918,103,898	0.6749	0.6799

第10特定期間末 (2011年11月10日)	3,174,422,389	3,200,542,950	0.6076	0.6126
第11特定期間末 (2012年5月10日)	2,942,283,607	2,958,746,313	0.6255	0.6290
第12特定期間末 (2012年11月12日)	2,755,197,492	2,770,826,230	0.6170	0.6205
第13特定期間末 (2013年5月10日)	3,372,265,613	3,386,433,677	0.8331	0.8366
第14特定期間末 (2013年11月11日)	2,826,036,326	2,838,532,137	0.7916	0.7951
第15特定期間末 (2014年5月12日)	2,615,870,672	2,626,894,130	0.8306	0.8341
第16特定期間末 (2014年11月10日)	2,438,285,558	2,445,128,906	0.8908	0.8933
第17特定期間末 (2015年5月11日)	2,106,332,670	2,112,162,760	0.9032	0.9057
第18特定期間末 (2015年11月10日)	1,853,001,272	1,856,294,425	0.8440	0.8455
第19特定期間末 (2016年5月10日)	1,618,028,115	1,621,254,105	0.7523	0.7538
第20特定期間末 (2016年11月10日)	1,561,397,528	1,563,530,863	0.7319	0.7329
第21特定期間末 (2017年5月10日)	1,576,785,224	1,578,754,950	0.8005	0.8015
第22特定期間末 (2017年11月10日)	1,515,682,218	1,517,446,577	0.8591	0.8601
2017年11月末日	1,492,857,831	-	0.8519	-
12月末日	1,488,095,576	-	0.8681	-
2018年1月末日	1,453,154,897	-	0.8634	-
2月末日	1,400,090,542	-	0.8354	-
3月末日	1,366,111,954	-	0.8192	-
4月末日	1,389,902,828	-	0.8405	-
第23特定期間末 (2018年5月10日)	1,392,998,583	1,394,652,872	0.8421	0.8431
5月末日	1,364,041,407	-	0.8308	-
6月末日	1,333,178,285	-	0.8268	-
7月末日	1,327,185,402	-	0.8333	-
8月末日	1,300,280,621	-	0.8272	-
9月末日	1,318,567,386	-	0.8472	-

10月末日	1,250,110,368	-	0.8080	-
第24特定期間末 (2018年11月12日)	1,258,210,178	1,259,756,691	0.8136	0.8146
11月末日	1,233,031,768	-	0.8035	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5特定期間	0.0150
第6特定期間	0.0150
第7特定期間	0.0150
第8特定期間	0.0150
第9特定期間	0.0150
第10特定期間	0.0150
第11特定期間	0.0105
第12特定期間	0.0105
第13特定期間	0.0105
第14特定期間	0.0105
第15特定期間	0.0105
第16特定期間	0.0095
第17特定期間	0.0075
第18特定期間	0.0065
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0040
第21特定期間	0.0030
第22特定期間	0.0030
第23特定期間	0.0030
第24特定期間	0.0030

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

【収益率の推移】

	収益率(%)
第5特定期間	1.7
第6特定期間	4.2
第7特定期間	0.9
第8特定期間	1.5
第9特定期間	4.8
第10特定期間	7.7
第11特定期間	4.7
第12特定期間	0.3

第13特定期間	36.7
第14特定期間	3.7
第15特定期間	6.3
第16特定期間	8.4
第17特定期間	2.2
第18特定期間	5.8
第19特定期間	10.3
第20特定期間	2.2
第21特定期間	9.8
第22特定期間	7.7
第23特定期間	1.6
第24特定期間	3.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5特定期間	262,772,801	135,765,038
第6特定期間	217,918,493	79,168,523
第7特定期間	207,270,473	258,469,336
第8特定期間	183,242,715	385,912,584
第9特定期間	173,219,903	551,547,101
第10特定期間	141,153,168	679,677,189
第11特定期間	103,970,374	624,452,296
第12特定期間	84,393,551	322,670,026
第13特定期間	80,023,659	497,359,212
第14特定期間	60,242,422	538,029,012
第15特定期間	48,791,311	469,463,422
第16特定期間	42,853,299	455,073,722
第17特定期間	33,393,329	438,696,400
第18特定期間	29,536,461	166,137,284
第19特定期間	35,191,350	79,966,689
第20特定期間	31,240,696	48,565,438
第21特定期間	25,904,022	189,512,877
第22特定期間	23,628,613	228,995,410
第23特定期間	22,527,421	132,597,227
第24特定期間	23,044,261	130,820,279

(参考) マザーファンド

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（2018年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	247,814,046,860	99.46
内 日本	247,814,046,860	99.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,350,748,864	0.54
純資産総額	249,164,795,724	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2018年11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	48 20年国債	日本	国債証券	15,901,000,000	107.34 17,068,630,630	105.42 16,763,629,250	2.500000 2020/12/21	6.73
2	142 20年国債	日本	国債証券	13,800,000,000	121.77 16,804,260,000	120.54 16,634,796,000	1.800000 2032/12/20	6.68
3	4 30年国債	日本	国債証券	12,600,000,000	134.32 16,924,668,000	132.01 16,633,386,000	2.900000 2030/11/20	6.68
4	1 30年国債	日本	国債証券	12,850,000,000	130.75 16,801,481,500	128.22 16,476,784,000	2.800000 2029/09/20	6.61
5	44 20年国債	日本	国債証券	15,845,000,000	104.12 16,499,351,500	103.42 16,387,849,700	2.500000 2020/03/20	6.58
6	6 30年国債	日本	国債証券	12,850,000,000	129.11 16,591,101,000	127.47 16,380,923,000	2.400000 2031/11/20	6.57
7	7 30年国債	日本	国債証券	12,750,000,000	127.05 16,199,473,000	126.77 16,164,067,500	2.300000 2032/05/20	6.49
8	95 20年国債	日本	国債証券	13,105,000,000	120.32 15,768,465,000	119.55 15,667,158,550	2.300000 2027/06/20	6.29
9	43 20年国債	日本	国債証券	13,572,000,000	104.64 14,202,820,800	102.43 13,901,799,600	2.900000 2019/09/20	5.58
10	64 20年国債	日本	国債証券	12,300,000,000	109.72 13,495,929,000	109.66 13,489,041,000	1.900000 2023/09/20	5.41

11	54	20年国債	日本	国債証券	12,387,000,000	108.80 13,477,799,220	107.11 13,267,715,700	2.200000 2021/12/20	5.32
12	70	20年国債	日本	国債証券	10,438,000,000	115.55 12,061,400,900	113.87 11,886,376,880	2.400000 2024/06/20	4.77
13	80	20年国債	日本	国債証券	10,173,000,000	115.32 11,732,290,400	114.23 11,620,617,900	2.100000 2025/06/20	4.66
14	101	20年国債	日本	国債証券	6,860,000,000	123.54 8,474,844,000	121.79 8,355,068,400	2.400000 2028/03/20	3.35
15	102	20年国債	日本	国債証券	6,700,000,000	124.15 8,318,050,000	122.15 8,184,050,000	2.400000 2028/06/20	3.28
16	86	20年国債	日本	国債証券	6,700,000,000	118.67 7,951,225,000	117.15 7,849,586,000	2.300000 2026/03/20	3.15
17	75	20年国債	日本	国債証券	4,274,000,000	115.21 4,924,453,400	113.71 4,860,221,840	2.100000 2025/03/20	1.95
18	68	20年国債	日本	国債証券	4,325,000,000	113.74 4,919,255,000	112.20 4,853,039,250	2.200000 2024/03/20	1.95
19	91	20年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	119.64 4,546,624,000	118.16 4,490,232,000	2.300000 2026/09/20	1.80
20	88	20年国債	日本	国債証券	3,760,000,000	119.16 4,480,604,000	117.66 4,424,166,400	2.300000 2026/06/20	1.78
21	42	20年国債	日本	国債証券	2,748,000,000	102.76 2,823,844,800	100.80 2,770,176,360	2.600000 2019/03/20	1.11
22	58	20年国債	日本	国債証券	2,225,000,000	108.59 2,416,127,500	107.70 2,396,436,250	1.900000 2022/09/20	0.96
23	59	20年国債	日本	国債証券	1,795,000,000	108.70 1,951,240,000	107.40 1,927,830,000	1.700000 2022/12/20	0.77
24	63	20年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	110.06 1,100,600,000	108.72 1,087,240,000	1.800000 2023/06/20	0.44
25	94	20年国債	日本	国債証券	500,000,000	118.96 594,800,000	117.46 587,320,000	2.100000 2027/03/20	0.24
26	55	20年国債	日本	国債証券	504,000,000	108.58 547,255,200	107.03 539,441,280	2.000000 2022/03/21	0.22
27	56	20年国債	日本	国債証券	200,000,000	109.07 218,140,000	107.54 215,094,000	2.000000 2022/06/20	0.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.46%
合計	99.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	27,578,940,679	94.74
内 ユーロ	7,023,078,068	24.13
内 ノルウェー	594,070,442	2.04
内 スウェーデン	554,338,242	1.90
内 デンマーク	822,725,864	2.83
内 イギリス	3,182,317,390	10.93
内 ポーランド	2,056,996,227	7.07
内 カナダ	2,594,825,720	8.91
内 アメリカ	7,099,623,753	24.39
内 オーストラリア	3,650,964,973	12.54
特殊債券	964,198,751	3.31
内 カナダ	964,198,751	3.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	565,707,741	1.94
純資産総額	29,108,847,171	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,763,610,153	9.49
内 日本	2,763,610,153	9.49
為替予約取引(売建)	2,793,684,110	9.60
内 日本	2,793,684,110	9.60

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2018年11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	45,000,000	89.93 4,592,318,125	91.36 4,665,336,070	1.625000 2026/02/15	16.03
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オースト ラリア	国債 証券	24,000,000	118.42 2,361,299,760	120.55 2,403,770,256	4.500000 2033/04/21	8.26
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	15,000,000	105.16 2,037,881,817	106.05 2,055,244,953	1.950000 2026/04/30	7.06
4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	9,300,000	122.27 1,648,924,661	124.15 1,674,332,153	5.000000 2025/03/07	5.75
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	15,800,000	98.32 1,326,975,611	99.89 1,348,205,385	2.250000 2025/06/01	4.63
6	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	10,000,000	98.78 1,276,138,820	99.67 1,287,753,001	1.400000 2028/04/30	4.42
7	Poland Government Bond	ポーランド	国債 証券	37,000,000	111.34 1,241,697,171	110.98 1,237,682,523	5.750000 2021/10/25	4.25
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	13,500,000	92.71 1,069,184,628	94.63 1,091,290,897	1.500000 2026/06/01	3.75
9	IRISH TREASURY	ユーロ	国債 証券	8,000,000	101.77 1,051,854,644	102.93 1,063,864,147	1.000000 2026/05/15	3.65
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,200,000	135.20 908,297,683	136.92 919,845,719	3.250000 2045/05/25	3.16
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,000,000	94.25 855,563,800	95.58 867,682,396	2.250000 2025/11/15	2.98

12	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	27,000,000	100.34 816,546,852	100.68 819,313,704	2.250000 2022/04/25	2.81
13	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	4,500,000	130.43 758,296,207	130.89 760,958,813	5.400000 2025/03/13	2.61
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,400,000	84.42 708,931,738	85.10 714,641,549	2.500000 2046/02/15	2.46
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	100.10 653,210,595	102.75 670,522,614	1.500000 2026/07/22	2.30
16	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,800,000	115.67 653,504,621	116.70 659,323,544	4.750000 2027/04/21	2.27
17	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	34,000,000	110.69 651,460,811	111.96 658,964,696	1.750000 2025/11/15	2.26
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	96.14 600,045,245	96.64 603,115,744	1.375000 2021/04/30	2.07
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,500,000	109.25 589,977,250	108.86 587,871,172	5.750000 2021/05/15	2.02
20	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	96.18 575,110,650	97.32 581,915,208	2.250000 2025/12/15	2.00
21	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	36,000,000	106.98 481,817,646	107.67 484,929,633	1.500000 2023/11/13	1.67
22	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,800,000	107.36 388,380,796	107.96 390,540,336	1.500000 2023/02/15	1.34
23	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,600,000	101.28 381,867,013	101.62 383,137,591	1.500000 2021/01/22	1.32
24	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	98.47 378,528,052	99.45 382,283,542	2.550000 2025/03/15	1.31
25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	106.49 282,845,408	107.53 285,599,680	3.000000 2024/03/14	0.98
26	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	143.83 278,728,716	143.64 278,352,774	3.750000 2045/06/22	0.96
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	133.02 257,776,682	137.53 266,518,324	2.500000 2046/08/15	0.92

28	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノル ウェー	国債 証券	18,000,000	106.26 254,015,856	106.26 254,025,417	3.750000 2021/05/25	0.87
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	2,300,000	93.89 245,055,939	95.35 248,847,993	2.375000 2027/05/15	0.85
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	1,500,000	109.90 239,048,985	110.34 240,014,751	4.000000 2022/03/07	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.74%
特殊債券	3.31%
合計	98.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2018年12月	買建	28,000,000	2,294,021,524	2,324,840,000	7.99%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2018年12月	買建	35,073,553	438,532,000	438,770,153	1.51%
		ユーロ売/円買 2018年12月	売建	3,400,000	438,532,000	439,212,000	1.51%
		カナダ・ドル売/円買 2018年12月	売建	26,824,386	2,294,021,524	2,290,266,110	7.87%
		米ドル売/円買 2018年12月	売建	200,000	22,720,400	22,686,000	0.08%
		豪ドル売/円買 2018年12月	売建	500,000	41,524,250	41,520,000	0.14%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	17,908,626,500	94.13
内 日本	17,908,626,500	94.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,117,270,494	5.87
純資産総額	19,025,896,994	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	583,800,000	3.07
内 日本	583,800,000	3.07

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産 (2018年11月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	145,000	4,347.00 630,315,000	4,183.00 606,535,000	3.19
2	三菱商事	日本	株式	卸売業	190,000	3,391.00 644,290,000	3,062.00 581,780,000	3.06
3	伊藤忠	日本	株式	卸売業	260,000	2,152.50 559,650,000	2,016.00 524,160,000	2.75
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	800,000	672.62 538,103,791	624.50 499,600,000	2.63

5	大和ハウス	日本	株式	建設業	135,000	3,338.42 450,687,784	3,575.00 482,625,000	2.54
6	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	70,000	6,459.86 452,190,884	6,803.00 476,210,000	2.50
7	住友商事	日本	株式	卸売業	210,000	1,788.68 375,623,357	1,743.50 366,135,000	1.92
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	75,000	4,800.41 360,031,426	4,680.00 351,000,000	1.84
9	三井物産	日本	株式	卸売業	190,000	1,957.50 371,925,000	1,774.50 337,155,000	1.77
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	60,000	5,337.25 320,235,475	5,605.00 336,300,000	1.77
11	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	47,500	5,318.00 252,605,000	5,535.00 262,912,500	1.38
12	任天堂	日本	株式	その他 製品	7,500	37,948.64 284,614,865	34,610.00 259,575,000	1.36
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	60,000	4,442.40 266,544,483	4,255.00 255,300,000	1.34
14	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	90,000	2,857.67 257,190,965	2,823.50 254,115,000	1.34
15	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	47,500	5,189.00 246,477,500	5,247.00 249,232,500	1.31
16	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,300,000	190.10 247,130,000	188.30 244,790,000	1.29
17	オリックス	日本	株式	その他 金融業	130,000	1,804.26 234,554,247	1,839.50 239,135,000	1.26
18	昭和シェル石油	日本	株式	石油・石 炭製品	135,000	2,337.47 315,558,694	1,759.00 237,465,000	1.25
19	電通	日本	株式	サービ ス業	45,000	5,434.92 244,571,596	5,060.00 227,700,000	1.20
20	マツオカコーポレーション	日本	株式	繊維製 品	69,500	3,265.00 226,917,500	3,245.00 225,527,500	1.19
21	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	70,000	3,011.00 210,770,000	3,202.00 224,140,000	1.18
22	双日	日本	株式	卸売業	550,000	396.00 217,800,000	402.00 221,100,000	1.16
23	ファナック	日本	株式	電気機 器	11,000	20,246.41 222,710,586	19,390.00 213,290,000	1.12
24	村田製作所	日本	株式	電気機 器	12,000	16,212.64 194,551,689	17,315.00 207,780,000	1.09

25	昭和電工	日本	株式	化学	45,000	5,459.82 245,692,040	4,550.00 204,750,000	1.08
26	信越化学	日本	株式	化学	20,000	9,152.05 183,041,070	10,135.00 202,700,000	1.07
27	三菱ケミカルHLDGS	日本	株式	化学	210,000	955.60 200,676,000	928.60 195,006,000	1.02
28	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	72,500	2,904.38 210,567,728	2,664.00 193,140,000	1.02
29	住友化学	日本	株式	化学	310,000	589.00 182,590,000	616.00 190,960,000	1.00
30	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	40,000	4,253.16 170,126,569	4,600.00 184,000,000	0.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.13%
合計	94.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	4.88%
食料品	1.34%
繊維製品	2.34%
パルプ・紙	0.44%
化学	9.62%
医薬品	5.32%
石油・石炭製品	2.49%
ゴム製品	0.97%
ガラス・土石製品	2.00%
鉄鋼	0.26%
非鉄金属	1.13%
金属製品	0.64%
機械	4.57%
電気機器	7.35%
輸送用機器	8.15%
精密機器	0.45%
その他製品	1.80%

陸運業	1.24%
空運業	0.48%
情報・通信業	6.01%
卸売業	13.21%
小売業	0.71%
銀行業	9.34%
証券、商品先物取引業	0.82%
保険業	4.18%
その他金融業	1.70%
不動産業	0.51%
サービス業	2.18%
合計	94.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年12月	買建	35	583,625,000	583,800,000	3.07%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2018年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,725,340,199	74.44
内 オランダ	20,857,088	0.90
内 カナダ	69,543,175	3.00

	内 アメリカ	1,634,939,936	70.54
ハイブリッド優先証券		399,603,932	17.24
	内 アメリカ	399,603,932	17.24
投資証券		44,320,562	1.91
	内 アメリカ	44,320,562	1.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		148,462,280	6.41
純資産総額		2,317,726,973	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (2018年11月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,966	12,432.90 74,174,729	12,503.25 74,594,445	3.22
2	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,922	15,190.22 59,576,078	16,549.59 64,907,529	2.80
3	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	470	127,147.67 59,759,407	124,201.99 58,374,937	2.52
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,367	16,596.46 55,880,367	15,736.01 52,983,178	2.29
5	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	14,150	3,659.40 51,780,616	3,468.77 49,083,207	2.12
6	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,082	15,892.60 48,981,018	15,783.67 48,645,293	2.10
7	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	アメリカ	株式	エネルギー	5,223	8,692.02 45,398,502	8,046.15 42,025,082	1.81
8	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	12,823	3,229.35 41,410,035	3,181.69 40,798,924	1.76

9	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	3,024	11,946.12 36,125,072	13,420.09 40,582,373	1.75
10	CVS HEALTH CORP	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,425	8,284.44 36,658,836	9,077.60 40,168,380	1.73
11	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,947	24,670.19 48,033,020	20,373.53 39,667,279	1.71
12	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	2,564	14,317.07 36,709,037	15,228.80 39,046,666	1.68
13	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	4,069	8,317.35 33,843,301	9,201.28 37,440,018	1.62
14	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,126	30,796.89 34,677,301	33,152.52 37,329,749	1.61
15	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	2,980	12,135.61 36,164,137	12,488.50 37,215,754	1.61
16	HERSHEY CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	3,042	11,803.14 35,905,196	12,192.35 37,089,133	1.60
17	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,725	13,121.67 35,756,553	12,851.61 35,020,643	1.51
18	AMERICAN EXPRESS CO	アメリカ	株式	金融	2,761	11,687.41 32,268,939	12,630.34 34,872,384	1.50
19	DOLLAR GENERAL CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,629	11,887.11 31,251,231	12,582.68 33,079,888	1.43
20	COLGATE-PALMOLIVE CO	アメリカ	株式	生活必需品	4,619	7,096.41 32,778,335	7,153.14 33,040,394	1.43
21	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	4,765	6,101.39 29,073,405	6,745.79 32,143,696	1.39
22	DOLLAR TREE INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,911	9,744.91 28,367,615	10,034.15 29,209,417	1.26
23	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	アメリカ	株式	金融	1,760	14,040.66 24,711,684	15,165.26 26,690,867	1.15
24	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,457	10,126.28 24,880,470	10,520.93 25,849,946	1.12

25	ROYAL BANK OF CANADA	カナダ	株式	金融	3,009	8,437.78 25,389,303	8,355.78 25,142,555	1.08
26	TE CONNECTIVITY LTD	アメリカ	株式	情報技術	2,913	8,903.99 25,937,325	8,589.67 25,021,735	1.08
27	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,583	13,904.61 22,011,004	15,642.97 24,762,828	1.07
28	DXC TECHNOLOGY CO	アメリカ	株式	情報技術	3,498	6,893.30 24,113,056	7,070.31 24,731,964	1.07
29	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,789	15,982.24 28,592,244	13,784.33 24,660,176	1.06
30	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,932	13,508.60 26,098,622	12,666.65 24,471,980	1.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	74.44%
ハイブリッド優先証券	17.24%
投資証券	1.91%
合計	93.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.05%
素材	2.01%
資本財・サービス	6.27%
一般消費財・サービス	6.60%
生活必需品	6.71%
ヘルスケア	10.85%
金融	11.44%
情報技術	13.51%
コミュニケーション・サービス	9.09%
公益事業	2.91%
合計	74.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2018年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,139,678,901	92.88
内 スウェーデン	29,719,537	2.42
内 イギリス	266,136,896	21.69
内 オランダ	142,901,650	11.65
内 フランス	181,340,035	14.78
内 ドイツ	191,188,752	15.58
内 スイス	207,695,493	16.93
内 スペイン	31,453,637	2.56
内 イタリア	74,789,285	6.10
内 フィンランド	14,453,616	1.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	87,335,589	7.12
純資産総額	1,227,014,490	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2018年11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,858	8,973.04 52,564,080	9,704.28 56,847,672	4.63
2	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	9,339.80 40,992,382	10,292.00 45,171,606	3.68

3	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	911.96 39,583,053	970.40 42,119,541	3.43
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーショ ン・サー ビス	21,145	1,789.92 37,848,015	1,987.58 42,027,551	3.43
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネル ギー	11,761	3,593.34 42,261,363	3,439.63 40,453,573	3.30
6	TOTAL SA	フラン ス	株式	エネル ギー	6,299	6,838.02 43,072,730	6,257.96 39,418,913	3.21
7	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	259,122.50 35,758,905	282,244.20 38,949,700	3.17
8	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フラン ス	株式	資本財・ サービ ス	4,676	7,994.27 37,381,240	8,312.08 38,867,308	3.17
9	KONINKLIJKE DSM NV	オラン ダ	株式	素材	3,798	10,342.95 39,282,529	10,076.82 38,271,762	3.12
10	SANOFI	フラン ス	株式	ヘルス ケア	3,682	9,531.63 35,095,492	10,189.21 37,516,691	3.06
11	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・ サービ ス	2,800	12,887.99 36,086,384	13,216.13 37,005,184	3.02
12	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,034	34,443.36 35,614,434	35,719.04 36,933,487	3.01
13	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルス ケア	15,900	2,072.77 32,957,090	2,316.67 36,835,208	3.00
14	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オラン ダ	株式	ヘルス ケア	8,394	4,547.48 38,171,614	4,250.35 35,677,446	2.91
15	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,302.03 34,171,389	2,245.47 33,331,903	2.72
16	ENAGAS SA	スペイ ン	株式	エネル ギー	10,115	2,866.72 28,996,935	3,109.60 31,453,637	2.56
17	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,239	23,583.63 29,220,123	24,817.39 30,748,757	2.51
18	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルス ケア	1,029	26,829.14 27,607,190	28,953.38 29,793,028	2.43
19	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事 業	48,153	553.96 26,675,159	614.68 29,598,975	2.41

20	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	87,929	287.83 25,309,072	327.75 28,819,172	2.35
21	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	9,623.36 28,831,596	9,411.49 28,196,829	2.30
22	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	14,849	2,017.94 29,964,507	1,836.56 27,271,154	2.22
23	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,218	8,916.69 28,693,921	8,379.26 26,964,470	2.20
24	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,074	23,411.81 25,144,286	24,437.58 26,245,961	2.14
25	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	631.66 25,689,125	596.57 24,261,951	1.98
26	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	コミュニケーション・サービス	96,642	218.96 21,161,225	243.26 23,509,980	1.92
27	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	6,448.51 25,729,590	5,784.48 23,080,084	1.88
28	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,620	13,358.24 21,640,359	13,287.19 21,525,250	1.75
29	ABN AMRO GROUP NV-CVA	オランダ	株式	金融	7,197	2,935.19 21,124,611	2,948.11 21,217,589	1.73
30	ALSTOM	フランス	株式	資本財・サービス	4,147	4,755.48 19,720,992	5,047.45 20,931,789	1.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.88%
合計	92.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	11.30%

素材	8.49%
資本財・サービス	7.89%
一般消費財・サービス	4.94%
生活必需品	7.83%
ヘルスケア	15.08%
金融	23.27%
情報技術	2.93%
コミュニケーション・サービス	7.69%
公益事業	3.46%
合計	92.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2018年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	692,057,320	90.93
内 韓国	136,270,238	17.90
内 中国	67,195,239	8.83
内 台湾	130,367,312	17.13
内 香港	106,900,540	14.05
内 シンガポール	47,746,298	6.27
内 オーストラリア	203,577,693	26.75
投資証券	24,489,325	3.22
内 オーストラリア	24,489,325	3.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,569,790	5.86
純資産総額	761,116,435	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2018年11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	56,000	870.30 48,737,309	842.72 47,192,320	6.20
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技 術	10,750	4,469.07 48,042,575	4,384.04 47,128,430	6.19
3	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	42,200	899.35 37,953,106	934.44 39,433,537	5.18
4	BHP BILLITON LIMITED	オースト ラリア	株式	素材	11,600	2,811.42 32,612,556	2,573.81 29,856,293	3.92
5	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	台湾	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	94,000	264.86 24,897,040	269.00 25,286,752	3.32
6	GOODMAN GROUP	オースト ラリア	投資証 券	-	27,600	830.80 22,930,080	887.29 24,489,325	3.22
7	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オースト ラリア	株式	金融	3,900	5,568.85 21,718,524	6,017.48 23,468,189	3.08
8	QANTAS AIRWAYS LTD	オースト ラリア	株式	資本財・ サービ ス	41,000	456.94 18,734,540	503.46 20,642,057	2.71
9	MACQUARIE GROUP LTD	オースト ラリア	株式	金融	2,000	9,598.23 19,196,465	9,704.57 19,409,150	2.55
10	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	台湾	株式	資本財・ サービ ス	168,000	122.36 20,556,480	104.14 17,496,192	2.30
11	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	韓国	株式	資本財・ サービ ス	8,800	1,820.31 16,018,766	1,920.24 16,898,112	2.22
12	WESTPAC BANKING CORP	オースト ラリア	株式	金融	7,500	2,197.46 16,480,995	2,194.97 16,462,302	2.16
13	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	台湾	株式	金融	92,000	186.20 17,131,136	178.66 16,437,088	2.16
14	ALUMINA LTD	オースト ラリア	株式	素材	82,000	220.16 18,053,284	191.91 15,737,014	2.07

15	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	9,500	1,590.96 15,114,250	1,643.98 15,617,839	2.05
16	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	7,300	2,061.30 15,047,861	2,081.36 15,193,986	2.00
17	COMFORTDELGRO CORP LTD	シンガポール	株式	資本財・サービス	85,300	192.71 16,444,976	173.24 14,777,381	1.94
18	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	2,800	5,323.84 14,906,752	4,927.60 13,797,280	1.81
19	LARGAN PRECISION CO LTD	台湾	株式	情報技術	1,000	13,082.40 13,082,400	12,935.20 12,935,200	1.70
20	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	6,000	2,152.60 12,915,617	2,069.52 12,417,137	1.63
21	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	韓国	株式	生活必需品	100	118,905.57 11,890,558	118,872.00 11,887,200	1.56
22	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	オーストラリア	株式	金融	19,129	576.65 11,032,193	617.28 11,808,033	1.55
23	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	1,900	6,482.73 12,317,192	6,085.61 11,562,659	1.52
24	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,600	2,024.17 11,335,373	2,004.28 11,223,969	1.47
25	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	中国	株式	ヘルスケア	12,000	929.67 11,156,183	930.81 11,169,798	1.47
26	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	香港	株式	情報技術	9,400	1,121.62 10,543,256	1,160.80 10,911,520	1.43
27	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	700	15,692.98 10,985,087	15,020.86 10,514,605	1.38
28	NETEASE INC-ADR	中国	株式	コミュニケーション・サービス	400	26,211.34 10,484,578	25,329.90 10,131,963	1.33
29	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	中国	株式	一般消費財・サービス	7,000	1,258.74 8,811,198	1,394.41 9,760,877	1.28
30	HKBN LTD	香港	株式	コミュニケーション・サービス	54,500	183.69 10,011,465	175.57 9,568,620	1.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	90.93%
投資証券	3.22%
合計	94.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.38%
素材	10.30%
資本財・サービス	11.15%
一般消費財・サービス	5.19%
生活必需品	2.56%
ヘルスケア	5.23%
金融	26.86%
情報技術	17.30%
コミュニケーション・サービス	6.88%
公益事業	1.03%
不動産	2.05%
合計	90.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 投資信託証券

Daiwa " RICI " Fund

(1) 有価証券（平成30年11月30日現在）

（単位：USドル）

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US TREASURY BILL 0PCT 23MAY19	51,000,000	50,434,130.04	
US TREASURY BILL 0PCT 06DEC18	50,000,000	49,982,023.65	

US TREASURY BILL OPCT 31JAN19	50,000,000	49,825,524.20	
US TREASURY BILL OPCT 28MAR19	47,000,000	46,664,420.00	
US TREASURY BILL OPCT 28FEB19	45,000,000	44,758,363.57	
US TREASURY BILL OPCT 04APR19	45,000,000	44,626,882.51	
US TREASURY BILL OPCT 18JUL19	44,000,000	43,300,660.12	
US TREASURY BILL OPC 20JUN19	40,000,000	39,468,591.28	
US TREASURY BILL 07MAR19	33,000,000	32,792,215.50	
TREASURY BILL OPCT 25APR19	30,000,000	29,725,415.89	

(2) 商品先物(平成30年11月30日現在)

(単位:USドル)

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
MILLING WHEAT (EOP) MAR-19	買建	891	-33,375.43	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-19	買建	243	-77,829.02	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-19	買建	870	-13,541,040.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) JAN-19	買建	614	467,450.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-18	買建	134	-19,975.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-18	売建	134	-604,750.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-19	買建	134	579,150.00	
GAS OIL (ICE) JAN-19	買建	89	-1,127,100.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-19	買建	240	-365,217.61	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-18	売建	406	322,037.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-18	買建	406	-1,375,162.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-19	買建	418	-385,562.50	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-18	売建	68	371,160.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-18	買建	68	-735,618.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-19	買建	73	-396,582.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-18	売建	165	179,262.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-18	買建	165	-391,875.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-19	買建	158	-225,368.75	
STANDARD LEAD (LME) DEC-18	売建	212	103,587.50	
STANDARD LEAD (LME) DEC-18	買建	212	-566,093.75	
STANDARD LEAD (LME) JAN-19	買建	212	-73,687.50	
TIN (LME) DEC-18	売建	56	241,390.00	
TIN (LME) DEC-18	買建	56	-184,110.00	
TIN (LME) JAN-19	買建	54	-228,330.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-19	買建	284	-132,025.00	
RUBBER (TCM) APR-19	買建	718	-230,421.44	
CORN (CBT) MAR-19	買建	1296	-259,125.00	

COTTON NO 2 (NYB) MAR-19	買建	553	-45,740.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) JAN-19	買建	149	-159,495.00	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) JAN-19	買建	203	-3,224,587.80	
GOLD (CMX) FEB-19	買建	210	-49,700.00	
HARD RED SPRING WHEAT (MGE) MAR-19	買建	177	-96,400.00	
HEATING OIL (NYM) JAN-19	買建	97	-1,625,425.20	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) JAN-19	買建	952	13,569,780.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-19	買建	193	-98,900.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) JAN-19	買建	1155	-17,210,650.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-19	買建	211	-146,300.00	
LUMBER (CME) JAN-19	買建	155	-248,930.00	
MILK FUTURE (CME) DEC-18	買建	17	-37,220.00	
OAT (CBT) MAR-19	買建	184	199,900.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-19	買建	14	127,790.00	
PLATINUM (NYM) JAN-19	買建	223	421,265.00	
ROUGH RICE (CBT) JAN-19	買建	183	264,530.00	
SILVER (CMX) MAR-19	買建	284	-239,595.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) JAN-19	買建	125	3,410.00	
SOYBEAN OIL (CBT) JAN-19	買建	614	-131,256.00	
SOYBEANS (CBT) JAN-19	買建	425	507,962.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-19	買建	342	546,168.00	
WHEAT (CBT) MAR-19	買建	541	-195,712.50	
WHEAT (CBT) MAR-19	買建	196	-284,975.00	

(注) L M E (ロンドン金属取引所)においては、先渡し売買となるため、期日到来まで
反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド

2018年11月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,035円
純資産総額	12億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-0.4%
3か月間	-2.6%
6か月間	-2.9%
1年間	-5.0%
3年間	-1.9%
5年間	4.0%
設定来	15.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
 ※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
 ※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 60円 設定来分配金合計額: 2,895円

決算期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期
	17年1月	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月	18年3月	18年5月	18年7月	18年9月	18年11月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国債券	35	34.7%	米ドル	34.6%	直接利回り(%)	DAIWA RICIFUND	ケイマン諸島	19.3%
国内株式・先物	144	19.6%	日本円	25.5%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.6%
外国投資信託	1	19.3%	ユーロ	12.0%	修正デュレーション	TOPIX先物 3012月	日本	0.6%
外国株式	153	17.4%	豪ドル	9.2%	残存年数	三菱商事	日本	0.6%
国内債券	27	4.6%	英ポンド	5.5%	債券格付別構成	伊藤忠	日本	0.6%
外国優先投資証券等	67	1.5%	ポーランド・ズロチ	2.6%	AAA	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
			カナダ・ドル	1.8%	AA	大和ハウス	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	1.4%	A	トヨタ自動車	日本	0.5%
			香港ドル	1.4%	BBB	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.4%
コール・ローン、その他	3.5%		その他	6.0%	BB	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.4%
合計	427	-	合計	100.0%	合計	合計	合計	24.1%

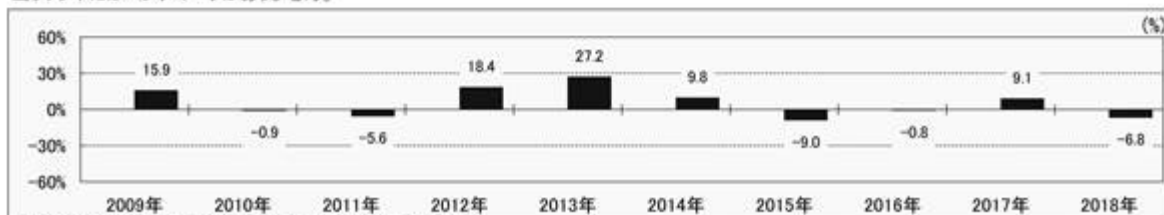
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2018年は11月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌々営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないません。

2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌々営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価(注)により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

(注) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ダイワ“RICI”ファンドの受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、および11月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年11月10日から2007年1月10日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、前4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 2.の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 3.または前 4.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年5月および11月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成30年5月11日から平成30年11月12日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成30年5月10日現在	当 期 平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,055	4,651
金銭信託	-	3,721,247
コール・ローン	7,836,467	6,365,824
投資信託受益証券	300,206,002	249,499,063
親投資信託受益証券	1,089,955,146	1,003,608,203
流動資産合計	1,397,999,670	1,263,198,988
資産合計	1,397,999,670	1,263,198,988
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,654,289	1,546,513
未払解約金	44,830	163,610
未払受託者報酬	120,148	119,406
未払委託者報酬	3,124,290	3,104,847
その他未払費用	57,530	54,434
流動負債合計	5,001,087	4,988,810
負債合計	5,001,087	4,988,810
純資産の部		
元本等		
元本	1,654,289,806	1,546,513,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 261,291,223	2 288,303,610
（分配準備積立金）	19,675,126	19,018,766
元本等合計	1,392,998,583	1,258,210,178
純資産合計	1,392,998,583	1,258,210,178
負債純資産合計	1,397,999,670	1,263,198,988

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成29年11月11日 至 平成30年5月10日		自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日	
営業収益				
受取利息		1,721		2,474
有価証券売買等損益		3,676,294		39,425,501
為替差損益		9,256,361		9,135,129
営業収益合計		12,930,934		30,287,898
営業費用				
支払利息		2,087		1,266
受託者報酬		383,919		363,072
委託者報酬		1 9,983,089		1 9,440,817
その他費用		239,936		273,391
営業費用合計		10,609,031		10,078,546
営業損失()		23,539,965		40,366,444
経常損失()		23,539,965		40,366,444
当期純損失()		23,539,965		40,366,444
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		703,339		206,956
期首剰余金又は期首欠損金()		248,677,394		261,291,223
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,756,096		21,779,250
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		18,756,096		21,779,250
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,494,617		3,917,175
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,494,617		3,917,175
分配金		2 5,038,682		2 4,714,974
期末剰余金又は期末欠損金()		261,291,223		288,303,610

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期 自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(2)特定期間末日

平成30年11月10日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成30年11月12日としております。このため、当特定期間は186日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首元本額	1,764,359,612円	1,654,289,806円
期中追加設定元本額	22,527,421円	23,044,261円
期中一部解約元本額	132,597,227円	130,820,279円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,654,289,806口	1,546,513,788口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は261,291,223円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は288,303,610円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成29年11月11日 至 平成30年5月10日	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 1 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	470,372円	462,904円

2. 2 分配金の計算過程

(自平成29年11月11日 至平成30年1月10日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,244,245円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(855,359円)及び分配準備積立金(16,122,194円)より分配対象額は20,221,798円(1万口当たり118.15円)であり、うち1,711,483円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成30年1月11日 至平成30年3月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(13,613円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(916,676円)及び分配準備積立金(17,180,081円)より分配対象額は18,110,370円(1万口当たり108.26円)であり、うち1,672,910円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成30年5月11日 至平成30年7月10日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,476,527円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,040,190円)及び分配準備積立金(19,038,420円)より分配対象額は21,555,137円(1万口当たり134.10円)であり、うち1,607,393円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成30年7月11日 至平成30年9月10日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(246,999円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,098,231円)及び分配準備積立金(18,279,895円)より分配対象額は19,625,125円(1万口当たり125.72円)であり、うち1,561,068円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

<p>（自平成30年3月13日 至平成30年5月10日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,051,328円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（983,785円）及び分配準備積立金（15,278,087円）より分配対象額は22,313,200円（1万口当たり134.88円）であり、うち1,654,289円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年9月11日 至平成30年11月12日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,855,891円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,196,930円）及び分配準備積立金（16,709,388円）より分配対象額は21,762,209円（1万口当たり140.72円）であり、うち1,546,513円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
--	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引（商品先物取引）に投資しており、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成30年11月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成30年5月10日現在	当 期 平成30年11月12日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	14,478,638	1,693,917
親投資信託受益証券	10,382,060	5,112,579
合計	24,860,698	3,418,662

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 平成30年5月10日現在	当 期 平成30年11月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期 自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成30年5月10日現在	当 期 平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8421円 (8,421円)	0.8136円 (8,136円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	アメリカ・ドル	DAIWA RICIFUND	35,481,500	アメリカ・ドル 2,189,740.770	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 2,189,740.770 (249,499,063)	
投資信託受益証券 合計				249,499,063 [249,499,063]	
親投資信託 受益証券	日本円	ダイワ・外債ソブリン・マザー ファンド	267,346,005	日本円 445,959,870	
		ダイワ日本国債マザーファンド	45,281,449	56,656,148	
		ダイワ好配当日本株マザーファ ンド	88,771,727	251,916,406	
		ダイワ北米好配当株マザーファ ンド	32,878,791	88,384,765	
		ダイワ欧州好配当株マザーファ ンド	53,456,345	85,332,363	
		ダイワ・アジア・オセアニア好 配当株マザーファンド	39,116,871	75,358,651	
	日本円	小計		日本円 1,003,608,203	

親投資信託受益証券 合計		1,003,608,203	
合計		1,253,107,266	[249,499,063]

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄	100%	100%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa "RICI" Fund」受益証券(米ドル建)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況及び同ファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	322,507,177
コール・ローン	784,712,754	551,703,313
国債証券	284,883,804,320	249,354,668,030
未収利息	1,517,459,460	1,420,127,661
前払費用	143,512,350	78,107,254
流動資産合計	287,329,488,884	251,727,113,435
資産合計	287,329,488,884	251,727,113,435
負債の部		
流動負債		
未払解約金	184,786,888	299,272,555
その他未払費用	6,018	3,795
流動負債合計	184,792,906	299,276,350
負債合計	184,792,906	299,276,350
純資産の部		
元本等		
元本	1 228,808,472,826	200,950,104,358
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	58,336,223,152	50,477,732,727
元本等合計	287,144,695,978	251,427,837,085
純資産合計	287,144,695,978	251,427,837,085
負債純資産合計	287,329,488,884	251,727,113,435

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--	--

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	260,830,303,985円	228,808,472,826円
期中追加設定元本額	1,381,605,693円	637,247,046円
期中一部解約元本額	33,403,436,852円	28,495,615,514円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドV A （適格機関投資家専用）	6,783,024円	5,836,064円
安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	268,446,677円	247,700,745円
6 資産バランスファンド（分 配型）	303,281,429円	289,709,843円
6 資産バランスファンド（成 長型）	165,422,344円	163,824,070円
ダイワ日本国債ファンド（毎 月分配型）	216,605,288,813円	189,699,644,029円
世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	95,280,529円	88,901,992円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	45,281,449円	45,281,449円
ダイワ日本国債ファンド（年 1回決算型）	11,068,617,162円	10,212,865,798円
ダイワ・ニッポン応援ファン ドVol.4 - 日本の真価 - （国債コース）	250,071,399円	196,340,368円
計	228,808,472,826円	200,950,104,358円
2. 期末日における受益権の総数	228,808,472,826口	200,950,104,358口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
--	--------------	---------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	954,875,840	3,357,648,820
合計	954,875,840	3,357,648,820

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成30年3月13日から平成30年5月10日まで、及び平成30年3月13日から平成30年11月12日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2550円 (12,550円)	1.2512円 (12,512円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 30年国債	12,850,000,000	16,442,217,500	
	2 30年国債	13,170,000,000	16,417,985,400	
	4 30年国債	12,600,000,000	16,583,112,000	
	6 30年国債	11,050,000,000	14,036,594,000	
	7 30年国債	2,150,000,000	2,715,536,000	
	4 2 20年国債	2,748,000,000	2,774,435,760	
	4 3 20年国債	13,572,000,000	13,926,229,200	
	4 4 20年国債	16,345,000,000	16,928,843,400	
	4 8 20年国債	15,901,000,000	16,786,844,710	
	5 4 20年国債	12,387,000,000	13,277,377,560	
	5 5 20年国債	504,000,000	539,763,840	

5 6	2 0 年国債	200,000,000	215,212,000	
5 8	2 0 年国債	2,225,000,000	2,397,526,500	
5 9	2 0 年国債	1,795,000,000	1,928,045,400	
6 3	2 0 年国債	1,000,000,000	1,087,300,000	
6 4	2 0 年国債	12,300,000,000	13,486,212,000	
6 8	2 0 年国債	4,325,000,000	4,852,001,250	
7 0	2 0 年国債	10,438,000,000	11,884,080,520	
7 5	2 0 年国債	4,274,000,000	4,857,614,700	
8 0	2 0 年国債	10,173,000,000	11,609,732,790	
8 6	2 0 年国債	6,700,000,000	7,838,062,000	
8 8	2 0 年国債	3,760,000,000	4,417,248,000	
9 1	2 0 年国債	3,800,000,000	4,482,746,000	
9 4	2 0 年国債	1,000,000,000	1,171,880,000	
9 5	2 0 年国債	13,105,000,000	15,636,623,900	
1 0 1	2 0 年国債	6,860,000,000	8,336,683,600	
1 0 2	2 0 年国債	6,700,000,000	8,169,176,000	
1 4 2	2 0 年国債	13,800,000,000	16,555,584,000	
国債証券 合計			249,354,668,030	
合計			249,354,668,030	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	310,891,495	198,126,078
金銭信託	-	7,039,169
コール・ローン	27,903,769	12,041,693
国債証券	28,933,939,174	27,510,005,042

特殊債券		964,776,044	965,559,646
派生商品評価勘定		16,524,067	20,029,074
未収入金		54,224,025	-
未収利息		216,074,934	236,787,522
前払費用		14,029,887	-
差入委託証拠金		130,179,417	131,767,866
流動資産合計		30,668,542,812	29,081,356,090
資産合計		30,668,542,812	29,081,356,090
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		262,000	375,669
未払解約金		30,587,264	37,276,329
その他未払費用		654	454
流動負債合計		30,849,918	37,652,452
負債合計		30,849,918	37,652,452
純資産の部			
元本等			
元本	1	18,567,565,077	17,410,838,452
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		12,070,127,817	11,632,865,186
元本等合計		30,637,692,894	29,043,703,638
純資産合計		30,637,692,894	29,043,703,638
負債純資産合計		30,668,542,812	29,081,356,090

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	19,354,980,293円	18,567,565,077円
期中追加設定元本額	429,202,071円	218,426,619円
期中一部解約元本額	1,216,617,287円	1,375,153,244円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン(適格機関投資家専用)	1,835,807,148円	1,739,512,045円
富山応援ファンド(地域企業株・外債バランス/毎月分配型)	669,890,631円	635,255,818円
ダイワ外債ソブリン・オープン(毎月分配型)	1,021,465,208円	941,634,590円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	50,538,318円	48,980,529円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	202,104,970円	186,502,446円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	371,710,519円	347,604,651円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	555,136,208円	505,718,648円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	240,681,260円	230,474,019円
6資産バランスファンド(分配型)	1,155,955,447円	1,103,016,778円
6資産バランスファンド(成長型)	125,587,307円	123,179,815円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	8,008,419,707円	7,440,446,714円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	72,303,103円	66,862,053円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	361,047,119円	328,761,417円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	1,014,869,035円	986,163,969円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	25,938,332円	24,732,706円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	292,008,408円	267,346,005円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	56,186,135円	-円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,160,258,970円	1,078,402,565円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	16,937,952円	15,413,469円

	四国アライアンス 地域創生 ファンド（年1回決算型）	913,242,950円	897,958,491円
	四国アライアンス 地域創生 ファンド（年2回決算型）	417,476,350円	442,871,724円
計		18,567,565,077円	17,410,838,452円
2.	期末日における受益権の総数	18,567,565,077口	17,410,838,452口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
-----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	287,725,616	88,658,223
特殊債券	11,099,311	1,649,957
合計	298,824,927	90,308,180

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成30年4月11日から平成30年5月10日まで、及び平成30年10月11日から平成30年11月12日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成30年5月10日 現在				平成30年11月12日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の 取引 為替予約取引 売 建	1,724,844,000	-	1,716,604,000	8,240,000	2,797,090,926	-	2,794,135,926	2,955,000

アメリカ・ドル	43,710,000	-	43,972,000	262,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	-	-	-	-	29,813,000	-	29,476,000	337,000
オーストラリア・ドル	1,233,150,000	-	1,229,850,000	3,300,000	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,326,195,926	-	2,326,195,926	0
ユーロ	447,984,000	-	442,782,000	5,202,000	441,082,000	-	438,464,000	2,618,000
買建	1,681,134,000	-	1,689,156,067	8,022,067	2,767,277,926	-	2,783,976,331	16,698,405
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	2,326,195,926	-	2,343,270,000	17,074,074
カナダ・ドル	1,233,150,000	-	1,233,973,200	823,200	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	447,984,000	-	455,182,867	7,198,867	441,082,000	-	440,706,331	375,669
合計	3,405,978,000	-	3,405,760,067	16,262,067	5,564,368,852	-	5,578,112,257	19,653,405

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.6501円	1.6681円
(1万口当たり純資産額)	(16,501円)	(16,681円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	アメリカ・ドル 8,000,000.000	アメリカ・ドル 7,560,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	45,000,000.000	40,601,700.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	7,400,000.000	6,223,474.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	5,800,000.000	5,582,036.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,300,000.000	2,165,036.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 62,132,246.000 (7,079,348,110)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	イギリス・ポンド 2,600,000.000	イギリス・ポンド 2,638,948.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,568,130.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,457,693.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,496,800.000	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,651,965.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 21,813,536.000 (3,215,097,071)		
オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	オーストラリア・ドル 7,000,000.000	オーストラリア・ドル 7,618,590.000		

	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	6,800,000.000	7,855,224.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	28,440,000.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 43,913,814.000 (3,613,667,754)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 1,779,660.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	16,000,000.000	15,781,120.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	12,591,315.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 30,152,095.000 (2,603,331,883)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 5,000,000.000	スウェーデン・クローナ 5,558,250.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,000,000.000	38,513,880.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 44,072,130.000 (552,664,510)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,500,000.000	デンマーク・クローネ 9,404,890.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	34,000,000.000	37,886,200.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 47,291,090.000 (817,662,946)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	ノルウェー・クローネ 18,000,000.000	ノルウェー・クローネ 19,098,360.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,074,760.000	

		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,351,400.000	
	ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 44,524,520.000 (601,081,020)	
	ポーランド・ズ ロチ	2.25% Poland Government Bond 20220425	27,000,000.000	27,175,500.000	
		5.75% Poland Government Bond 20211025	37,000,000.000	41,168,050.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 68,343,550.000 (2,055,090,549)	
	ユーロ	1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	2,800,000.000	3,016,216.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	2,041,080.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	7,099,664.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,164,395.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	4,500,000.000	5,878,035.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,188,160.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	15,000,000.000	15,789,000.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	9,887,200.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 54,063,750.000 (6,972,061,199)	
国債証券 合計				27,510,005,042 [27,510,005,042]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	4,500,000.000	4,437,045.000	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	6,746,180.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 11,183,225.000	

		(965,559,646)	
特殊債券 合計		965,559,646	[965,559,646]
合計		28,475,564,688	[28,475,564,688]

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 5銘柄	100%	24.9%
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	100%	11.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.7%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄 特殊債券 2銘柄	100%	12.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	1.9%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	2.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	2.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	7.2%
ユーロ	国債証券 8銘柄	100%	24.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	395,719,401
コール・ローン	949,932,501	676,945,258

株式	19,770,643,000	18,045,298,000
派生商品評価勘定	35,578,400	-
未収入金	179,033,933	276,899,709
未収配当金	239,912,000	219,712,550
前払金	-	30,600,000
差入委託証拠金	18,000,000	21,525,000
流動資産合計	21,193,099,834	19,666,699,918
資産合計	21,193,099,834	19,666,699,918
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	30,968,900
前受金	33,600,000	-
未払金	287,390,520	290,370,752
未払解約金	77,000	384,000
その他未払費用	11,275	8,819
流動負債合計	321,078,795	321,732,471
負債合計	321,078,795	321,732,471
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,859,070,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,012,950,304
元本等合計		20,872,021,039
純資産合計		19,344,967,447
負債純資産合計		21,193,099,834

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	7,074,251,203円	6,859,070,735円
期中追加設定元本額	469,789,613円	490,288,805円
期中一部解約元本額	684,970,081円	532,463,473円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	5,400,022,642円	5,271,845,332円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	28,052,281円	26,699,736円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	31,641,606円	30,696,942円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	28,740,608円	27,767,959円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	533,448,022円	508,343,366円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	90,006,369円	88,771,727円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	90,129,440円	85,956,807円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	107,079,393円	127,569,891円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	216,042,443円	254,372,043円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	333,907,931円	394,872,264円
計	6,859,070,735円	6,816,896,067円
2. 期末日における受益権の総数	6,859,070,735口	6,816,896,067口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	562,086,047	146,017,487
合計	562,086,047	146,017,487

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成30年4月17日から平成30年5月10日まで、及び平成30年10月16日から平成30年11月12日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成30年5月10日 現在				平成30年11月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	675,800,000	-	711,400,000	35,600,000	615,800,000	-	584,850,000	30,950,000

合計	675,800,000	-	711,400,000	35,600,000	615,800,000	-	584,850,000	30,950,000
----	-------------	---	-------------	------------	-------------	---	-------------	------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	3.0430円	2.8378円
(1万口当たり純資産額)	(30,430円)	(28,378円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
熊谷組	32,500	3,440.00	111,800,000	
五洋建設	110,000	705.00	77,550,000	
大和ハウス	135,000	3,584.00	483,840,000	
ライト工業	30,000	1,450.00	43,500,000	
ディー・エヌ・エー	20,000	2,143.00	42,860,000	
双日	575,000	421.00	242,075,000	
日本たばこ産業	87,500	2,870.50	251,168,750	
アルコニックス	40,000	1,325.00	53,000,000	
富士紡ホールディングス	7,500	3,475.00	26,062,500	
ダイワボウHD	18,500	6,770.00	125,245,000	
三洋貿易	25,000	2,078.00	51,950,000	
セブン&アイ・HLDGS	27,500	5,030.00	138,325,000	
帝人	47,500	1,954.00	92,815,000	
東レ	60,000	901.00	54,060,000	
旭化成	110,000	1,243.00	136,730,000	
サカイオーベックス	15,000	2,421.00	36,315,000	
SUMCO	45,000	1,638.00	73,710,000	
マツオカコーポレーション	69,500	3,495.00	242,902,500	
王子ホールディングス	125,000	764.00	95,500,000	

昭和電工	45,000	4,865.00	218,925,000
住友化学	330,000	610.00	201,300,000
クレハ	15,000	7,880.00	118,200,000
東亜合成	30,000	1,231.00	36,930,000
デンカ	22,500	3,590.00	80,775,000
信越化学	17,500	10,170.00	177,975,000
日本化学工業	15,000	2,701.00	40,515,000
日本触媒	9,500	7,080.00	67,260,000
カネカ	21,000	4,440.00	93,240,000
三菱瓦斯化学	20,000	1,844.00	36,880,000
三井化学	25,000	2,811.00	70,275,000
J S R	15,000	1,790.00	26,850,000
三菱ケミカルH L D G S	210,000	940.40	197,484,000
宇部興産	20,000	2,563.00	51,260,000
旭有機材	17,500	2,038.00	35,665,000
ダイキアクシス	35,000	1,350.00	47,250,000
電通	45,000	5,340.00	240,300,000
花 王	15,000	7,752.00	116,280,000
三洋化成	5,000	5,450.00	27,250,000
武田薬品	65,000	4,559.00	296,335,000
アステラス製薬	100,000	1,712.00	171,200,000
塩野義製薬	12,500	7,528.00	94,100,000
小野薬品	39,000	2,709.50	105,670,500
沢井製薬	18,000	5,910.00	106,380,000
大塚ホールディングス	47,500	5,683.00	269,942,500
ヤフー	250,000	327.00	81,750,000
トレンドマイクロ	14,000	6,410.00	89,740,000
構造計画研究所	15,000	2,190.00	32,850,000
日本ハウズイング	8,200	2,900.00	23,780,000
ポーラ・オルビスHD	10,000	3,045.00	30,450,000
デクセリアルズ	30,000	1,005.00	30,150,000
昭和シェル石油	125,000	2,025.00	253,125,000
出光興産	20,000	4,785.00	95,700,000
J X T Gホールディングス	250,000	724.90	181,225,000
ブリヂストン	27,500	4,263.00	117,232,500
A G C	17,500	3,880.00	67,900,000
ノ ザ ワ	20,000	1,088.00	21,760,000
東海カーボン	130,000	1,769.00	229,970,000
フジインコーポレーテッド	15,000	2,544.00	38,160,000
ニチアス	10,000	2,381.00	23,810,000

J F Eホールディングス	25,000	2,172.50	54,312,500
大紀アルミニウム	80,000	704.00	56,320,000
日本軽金属HD	200,000	247.00	49,400,000
住友鉱山	10,000	3,397.00	33,970,000
住友電工	40,000	1,578.00	63,120,000
東プレ	15,000	2,409.00	36,135,000
タクマ	35,000	1,480.00	51,800,000
東芝機械	21,000	2,004.00	42,084,000
アイダエンジニア	110,000	966.00	106,260,000
DMG森精機	55,000	1,563.00	85,965,000
豊田自動織機	10,000	5,720.00	57,200,000
イワキポンプ	25,000	1,384.00	34,600,000
野村マイクロ・サイエンス	10,000	782.00	7,820,000
小松製作所	57,500	3,115.00	179,112,500
住友重機械	25,000	3,690.00	92,250,000
荏原実業	30,000	1,879.00	56,370,000
三精テクノロジーズ	27,500	1,733.00	47,657,500
ダイフク	11,000	5,440.00	59,840,000
キトー	47,500	1,919.00	91,152,500
日本精工	70,000	1,088.00	76,160,000
三菱電機	105,000	1,464.50	153,772,500
日本電産	7,500	14,530.00	108,975,000
愛知電機	20,000	3,160.00	63,200,000
パナソニック	125,000	1,160.00	145,000,000
T D K	11,000	9,570.00	105,270,000
マクセルホールディングス	50,000	1,643.00	82,150,000
デンソー	47,500	5,225.00	248,187,500
ファナック	7,000	20,085.00	140,595,000
太陽誘電	10,000	2,325.00	23,250,000
村田製作所	13,000	17,850.00	232,050,000
日産自動車	105,000	1,029.00	108,045,000
トヨタ自動車	70,000	6,709.00	469,630,000
日野自動車	75,000	1,091.00	81,825,000
三菱自動車工業	375,000	762.00	285,750,000
武蔵精密工業	20,000	1,720.00	34,400,000
アイシン精機	19,000	4,395.00	83,505,000
本田技研	70,000	3,282.00	229,740,000
S U B A R U	25,000	2,674.50	66,862,500
萩原電気HLDGS	17,500	3,325.00	58,187,500
キヤノン	55,000	3,298.00	181,390,000

バンダイナムコHLDGS	19,000	4,750.00	90,250,000	
任天堂	6,000	36,290.00	217,740,000	
伊藤忠	260,000	2,080.00	540,800,000	
三井物産	190,000	1,896.00	360,240,000	
東京エレクトロン	8,000	15,295.00	122,360,000	
住友商事	190,000	1,782.00	338,580,000	
日本ユニシス	30,000	2,764.00	82,920,000	
三菱商事	190,000	3,117.00	592,230,000	
阪和興業	17,500	3,445.00	60,287,500	
ニプロ	40,000	1,496.00	59,840,000	
伊藤忠エネクス	60,000	1,099.00	65,940,000	
あおぞら銀行	27,500	3,955.00	108,762,500	
三菱UFJフィナンシャルG	800,000	680.00	544,000,000	
りそなホールディングス	200,000	611.00	122,200,000	
三井住友トラストHD	27,500	4,610.00	126,775,000	
三井住友フィナンシャルG	145,000	4,502.00	652,790,000	
セブン銀行	150,000	377.00	56,550,000	
みずほフィナンシャルG	1,300,000	196.60	255,580,000	
SBIホールディングス	50,000	3,165.00	158,250,000	
日立キャピタル	30,000	3,020.00	90,600,000	
オリックス	130,000	1,809.50	235,235,000	
野村ホールディングス	110,000	528.00	58,080,000	
いちよし証券	10,000	972.00	9,720,000	
SOMPOホールディングス	25,000	4,893.00	122,325,000	
MS&AD	45,000	3,548.00	159,660,000	
第一生命HLDGS	80,000	2,217.50	177,400,000	
東京海上HD	51,500	5,542.00	285,413,000	
T&Dホールディングス	55,000	1,870.50	102,877,500	
三井不動産	20,000	2,751.50	55,030,000	
サンフロンティア不動産	35,000	1,178.00	41,230,000	
西日本旅客鉄道	16,000	7,886.00	126,176,000	
日本通運	7,500	7,440.00	55,800,000	
SGホールディングス	20,000	2,834.00	56,680,000	
日本航空	24,000	4,111.00	98,664,000	
西本WISMETTAC HD	8,600	5,140.00	44,204,000	
日本電信電話	75,000	4,573.00	342,975,000	
KDDI	72,500	2,466.50	178,821,250	
NTTドコモ	75,000	2,550.00	191,250,000	
丹青社	85,000	1,132.00	96,220,000	
コナミホールディングス	12,000	5,050.00	60,600,000	

日鉄住金物産	9,000	5,310.00	47,790,000	
ソフトバンクグループ	5,000	8,777.00	43,885,000	
合計			18,045,298,000	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	36,467,755	82,944,620
金銭信託	-	25,942,672
コール・ローン	68,153,131	44,379,347
株式	1,601,628,375	1,730,668,981
ハイブリッド優先証券	422,859,171	412,230,914
投資証券	46,958,472	45,630,291
未収入金	5,727,624	10,410,309
未収配当金	1,936,535	1,964,500
未収利息	870,079	1,280,450
流動資産合計	2,184,601,142	2,355,452,084
資産合計	2,184,601,142	2,355,452,084
負債の部		
流動負債		
未払金	6,427,480	22,393,960
未払解約金	48,000	865,000
その他未払費用	726	428
流動負債合計	6,476,206	23,259,388

負債合計		6,476,206	23,259,388
純資産の部			
元本等			
元本	1	871,352,002	867,569,590
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		1,306,772,934	1,464,623,106
元本等合計		2,178,124,936	2,332,192,696
純資産合計		2,178,124,936	2,332,192,696
負債純資産合計		2,184,601,142	2,355,452,084

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

	<p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	835,013,823円	871,352,002円
期中追加設定元本額	62,797,186円	62,696,170円
期中一部解約元本額	26,459,007円	66,478,582円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,748,365円	10,836,111円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,555,045円	10,024,161円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	216,924,047円	183,329,363円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	37,006,944円	32,878,791円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	36,749,126円	31,395,290円
米国好配当株オープン（予想分配金提示型）	416,476円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	90,405,911円	98,742,591円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	182,754,162円	195,354,316円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	282,791,926円	305,008,967円
計	871,352,002円	867,569,590円
2. 期末日における受益権の総数	871,352,002口	867,569,590口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	9,009,833	25,253,769
ハイブリッド優先証券	1,976,619	1,336,909
投資証券	271,659	258,533
合計	6,761,555	26,849,211

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成30年4月17日から平成30年5月10日まで、及び平成30年10月16日から平成30年11月12日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,4997円 (24,997円)	2,6882円 (26,882円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	PALO ALTO NETWORKS INC	680	183.090	124,501.200	
	ABBOTT LABORATORIES	2,156	72.790	156,935.240	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,235	159.900	197,476.500	
	DOLLAR TREE INC	2,506	86.380	216,468.280	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	4,069	79.080	321,776.520	
	TE CONNECTIVITY LTD	2,913	79.130	230,505.690	
	APPLE INC	1,742	204.470	356,186.740	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,765	58.460	278,561.900	
	JPMORGAN CHASE & CO	2,980	111.290	331,644.200	
	DOLLAR GENERAL CORP	2,951	116.100	342,611.100	
	TELEFLEX INC	277	265.880	73,648.760	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	4,619	63.800	294,692.200	
	AMAZON.COM INC	79	1,712.430	135,281.970	
	NEXTERA ENERGY INC	929	176.560	164,024.240	
	GENERAL DYNAMICS CORP	655	184.500	120,847.500	
	ALPHABET INC-CL A	470	1,077.020	506,199.400	
	HOME DEPOT INC	798	185.990	148,420.020	
HERSHEY CO/THE	3,042	108.580	330,300.360		
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,217	83.690	185,540.730		

TRINSEO SA	1,008	55.770	56,216.160	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,789	123.540	221,013.060	
JOHNSON & JOHNSON	3,922	145.340	570,023.480	
FACEBOOK INC-CLASS A	2,465	144.960	357,326.400	
DXC TECHNOLOGY CO	1,745	62.000	108,190.000	
MERCK & CO. INC.	2,443	74.860	182,882.980	
NORTHROP GRUMMAN CORP	500	285.730	142,865.000	
APTIV PLC	2,055	75.620	155,399.100	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	5,223	73.550	384,151.650	
XCEL ENERGY INC	3,348	50.340	168,538.320	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,941	92.410	179,367.810	
PEPSICO INC	3,024	117.480	355,259.520	
ACCENTURE PLC-CL A	929	165.150	153,424.350	
SCHLUMBERGER LTD	2,712	50.400	136,684.800	
AT&T INC	14,150	30.690	434,263.500	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,725	109.510	298,414.750	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,583	131.490	208,148.670	
ANTHEM INC	1,126	287.060	323,229.560	
WALT DISNEY CO/THE	1,373	118.000	162,014.000	
WASTE MANAGEMENT INC	2,457	90.460	222,260.220	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,082	143.930	443,592.260	
PPL CORP	10,703	31.690	339,178.070	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,760	134.230	236,244.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	457	243.450	111,256.650	
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,063	64.500	197,563.500	
BANK OF AMERICA CORP	12,823	28.520	365,711.960	
AMERICAN EXPRESS CO	2,761	108.280	298,961.080	
ANALOG DEVICES INC	1,570	87.590	137,516.300	
ALASKA AIR GROUP INC	2,200	65.970	145,134.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,514	107.170	269,425.380	
AON PLC	1,385	164.540	227,887.900	
EATON CORP PLC	2,690	73.430	197,526.700	
CIMAREX ENERGY CO	1,923	90.320	173,685.360	
ECOLAB INC	1,356	159.330	216,051.480	
SNAP-ON INC	899	161.490	145,179.510	
MICROSOFT CORP	6,164	109.570	675,389.480	
CVS HEALTH CORP	4,163	79.830	332,332.290	

	MEDTRONIC PLC	2,121	94.360	200,137.560	
	CHUBB LTD	2,564	131.170	336,319.880	
	STARBUCKS CORP	2,773	68.600	190,227.800	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 14,574,617.840 (1,660,631,957)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	6,165	44.410	273,787.650	
	ROYAL BANK OF CANADA	3,009	95.950	288,713.550	
	ENBRIDGE INC	5,718	43.490	248,675.820	
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 811,177.020 (70,037,024)	
合計				1,730,668,981 [1,730,668,981]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	6,057.000	153,060.390	
		CHS INC 7.5 4	5,000.000	133,625.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	3,475.000	88,126.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,100.000	28,259.000	
		SCE TRUST IV 5.375 J	442.000	10,510.760	
		SOUTHERN CO 6.25	4,040.000	104,312.800	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	3,775.000	95,016.750	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	1,854.000	46,220.220	
		BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	2,078.000	53,196.800	
		CITIGROUP INC 6.3 S	7,300.000	187,172.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	1,948.000	49,966.200	
		EBAY INC 6	666.000	17,096.220	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	2,675.000	66,447.000	
		SCE TRUST V 5.45 K	609.000	14,829.150	
		KKR & CO INC 6.75 A	693.000	18,239.760	

BANK OF AMERICA CORP 6 EE	3,056.000	77,194.560	
STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	723.000	18,226.830	
LEGG MASON INC 5.45	775.000	18,119.500	
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	26,196.000	
SOUTHERN CO 5.25	796.000	17,973.680	
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	26,526.000	
MORGAN STANLEY 5.85 K	1,476.000	37,091.880	
DTE ENERGY CO 6 F	926.000	23,548.180	
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	1,125.000	28,485.000	
SCE TRUST VI 5	2,831.000	58,658.320	
VALLEY NATIONAL BANCORP FR B	1,101.000	27,057.070	
TCF FINANCIAL CO 5.7 C	1,975.000	46,965.500	
SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	45,083.390	
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.7	9,000.000	210,150.000	
ENBRIDGE INC FR B	5,975.000	147,582.500	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	4,775.000	120,855.250	
UNUM GROUP 6.25	2,700.000	67,338.000	
KKR & CO INC 6.5 B	750.000	19,500.000	
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	2,525.000	64,867.250	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	1,200.000	30,396.000	
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	53,088.000	
WELLS FARGO & COMPANY 6 T	7,000.000	177,590.000	
CITIGROUP CAPITAL XIII FR	2,275.000	60,333.000	
PARTNERRE LTD 6.5 G	1,851.000	48,051.960	
MORGAN STANLEY 6.875 F	2,599.000	69,549.240	
ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	5,334.000	140,764.260	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	1,900.000	50,217.000	
US BANCORP 6.5 F	1,000.000	26,770.000	
BB&T CORPORATION 5.85	2,026.000	50,487.920	
BB&T CORPORATION 5.625 E	2,497.000	60,527.280	
MORGAN STANLEY 6.375 I	2,933.000	77,049.910	

		NUSTAR LOGISTICS LP FR	6,175.000	155,980.500	
		REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	3,043.000	80,152.620	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 B	4,800.000	120,528.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.25 C	2,000.000	50,860.000	
		STATE STREET CORP 5.9 D	1,925.000	50,338.750	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	863.000	21,963.350	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	957.000	24,279.090	
		PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B	4,850.000	121,541.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 3,617,964.840 (412,230,914)	
ハイブリッド優先証券		合計		412,230,914 [412,230,914]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	793	20,031.180	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1,750	41,475.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	1,975	47,242.000	
		COLONY CAPITAL INC 8.75 E	2,150	54,104.750	
		GLOBAL NET LEASE INC 7.25 A	1,100	27,500.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIA 6 A	2,550	61,429.500	
		VORNADO REALTY TRUST 5.25 M	425	9,222.500	
		PS BUSINESS PARKS INC 5.2 Y	825	17,861.250	
		QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	29,351.500	
		KIMCO REALTY CORP 5.625 K	875	19,888.750	
		NATIONAL RETAIL PROP INC 5.7 E	1,058	25,466.060	
		SITE CENTERS CORP 6.5 J	2,050	46,904.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 400,476.490 (45,630,291)	
投資証券		合計		45,630,291 [45,630,291]	

合計		457,861,205	
		[457,861,205]	

ハイブリッド優先証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 ハイブリッド 優先証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率	
アメリカ・ドル	株式	59銘柄	78.3%	19.5%	2.2%	
	ハイブリッド	54銘柄				
	優先証券	12銘柄				
	投資証券					
カナダ・ドル	株式	3銘柄	100%	-%	-%	3.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	46,301,462	55,639,545
金銭信託	-	12,812,462
コール・ローン	13,751,261	21,917,892
株式	1,241,875,960	1,146,178,418
未収配当金	4,278,428	998,202
流動資産合計	1,306,207,111	1,237,546,519
資産合計	1,306,207,111	1,237,546,519
負債の部		

流動負債		
未払解約金	1,000,000	2,058,000
その他未払費用	326	276
流動負債合計	1,000,326	2,058,276
負債合計	1,000,326	2,058,276
純資産の部		
元本等		
元本	1	775,897,011
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	529,309,774	461,515,211
元本等合計	1,305,206,785	1,235,488,243
純資産合計	1,305,206,785	1,235,488,243
負債純資産合計	1,306,207,111	1,237,546,519

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	779,132,028円	775,897,011円
期中追加設定元本額	33,382,269円	46,525,194円
期中一部解約元本額	36,617,286円	48,449,173円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	18,843,762円	17,639,183円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,824,713円	16,232,681円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	320,562,608円	302,415,464円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	57,165,219円	53,456,345円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	54,170,146円	51,202,245円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	50,337,608円	54,472,040円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	101,386,247円	108,582,605円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	156,606,708円	169,972,469円
計	775,897,011円	773,973,032円
2. 期末日における受益権の総数	775,897,011口	773,973,032口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
-----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	50,893,960	33,912,688
合計	50,893,960	33,912,688

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成30年4月17日から平成30年5月10日まで、及び平成30年10月16日から平成30年11月12日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6822円 (16,822円)	1.5963円 (15,963円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	16.040	238,097.760	
	AVIVA PLC	40,669	4.337	176,381.450	

	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	15.704	249,693.600	
	VODAFONE GROUP PLC	96,642	1.439	139,087.160	
	KINGFISHER PLC	30,751	2.551	78,445.800	
	NATIONAL GRID PLC	10,672	8.557	91,320.300	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,047	33.145	167,282.810	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	6.338	275,094.550	
	CARNIVAL PLC	3,111	43.710	135,981.810	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	24.180	284,380.980	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,835,766.220 (270,573,583)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,029	251.350	258,639.150	
	NESTLE SA-REG	5,858	85.400	500,273.200	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,034	314.400	325,089.600	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	89.720	393,781.080	
	GIVAUDAN-REG	138	2,406.000	332,028.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 1,809,811.030 (204,997,295)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	SWEDBANK AB - A SHARES	5,994	208.100	1,247,351.400	
	NORDEA BANK ABP	13,623	80.700	1,099,376.100	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 2,346,727.500 (29,427,962)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	102.340	286,552.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	73.360	219,786.560	
	BASF SE	3,218	68.850	221,559.300	
	ALLIANZ SE-REG	1,074	192.000	206,208.000	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	192.750	238,817.250	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	14.695	310,725.770	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,394	33.605	282,080.370	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	22.600	147,035.600	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,798	79.100	300,421.800	

KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.385	209,710.660	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	7,197	23.080	166,106.760	
TOTAL SA	6,299	50.490	318,036.510	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	63.880	298,702.880	
BNP PARIBAS	3,990	46.365	184,996.350	
CAPGEMINI SE	1,620	109.600	177,552.000	
ALSTOM	4,147	38.020	157,668.940	
SANOFI	3,682	80.200	295,296.400	
INTESA SANPAOLO	68,243	2.005	136,861.330	
ENI SPA	14,849	15.456	229,506.140	
ENEL SPA	48,153	4.483	215,869.890	
ENAGAS SA	10,115	24.600	248,829.000	
NOKIA OYJ	23,125	5.172	119,602.500	
ユーロ 小計			ユーロ 4,971,926.010 (641,179,578)	
合計			1,146,178,418 [1,146,178,418]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	23.6%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	17.9%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	100%	2.6%
ユーロ	株式 22銘柄	100%	55.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	11,315,907	67,616,147
金銭信託	-	1,529,795
コール・ローン	8,061,488	2,616,975
株式	841,080,871	660,671,794
投資証券	-	23,734,082
未収入金	-	314,512
未収配当金	1,471,842	1,167,168
流動資産合計	861,930,108	757,650,473
資産合計	861,930,108	757,650,473
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	671,000
その他未払費用	50	67
流動負債合計	50	671,067
負債合計	50	671,067
純資産の部		
元本等		
元本	1 379,998,187	392,927,944
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	481,931,871	364,051,462
元本等合計	861,930,058	756,979,406
純資産合計	861,930,058	756,979,406
負債純資産合計	861,930,108	757,650,473

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p>

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1. 1 期首	平成29年11月11日	平成30年5月11日
期首元本額	406,151,611円	379,998,187円
期中追加設定元本額	6,586,643円	19,957,827円
期中一部解約元本額	32,740,067円	7,028,070円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,647,901円	15,154,627円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,431,375円	12,486,286円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	233,357,045円	235,508,161円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	39,116,871円	39,116,871円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	39,121,609円	39,223,517円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	6,888,201円	8,521,244円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	13,920,813円	16,777,147円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	21,514,372円	26,140,091円
計	379,998,187円	392,927,944円
2. 期末日における受益権の総数	379,998,187口	392,927,944口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月11日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年11月12日現在
-----	---------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	16,157,393	6,497,673
投資証券	-	1,022,042
合計	16,157,393	5,475,631

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成30年4月17日から平成30年5月10日まで、及び平成30年10月16日から平成30年11月12日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年5月10日現在	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2682円 (22,682円)	1.9265円 (19,265円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	

	BHP BILLITON LIMITED	11,600	33.410	387,556.000	
	ALUMINA LTD	82,000	2.490	204,180.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,600	33.770	87,802.000	
	OZ MINERALS LTD	10,400	9.290	96,616.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,000	24.900	149,400.000	
	WESTPAC BANKING CORP	7,500	27.700	207,750.000	
	RIO TINTO LTD	1,900	81.230	154,337.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,900	70.950	276,705.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	41,000	5.830	239,030.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,000	123.640	247,280.000	
	CSL LTD	700	190.580	133,406.000	
	COCHLEAR LTD	600	176.130	105,678.000	
	SUNCORP GROUP LTD	7,900	14.080	111,232.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,129	7.220	138,111.380	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,539,083.380 (208,941,171)	
オフショア・人民元	株 CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	7,800	42.600	オフショア・人民元 332,280.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 332,280.000 (5,449,391)	
シンガポール・ドル	株 DBS GROUP HOLDINGS LTD COMFORTDELGRO CORP LTD BREADTALK GROUP LTD	5,600 85,300 195,300	23.740 2.180 0.895	シンガポール・ドル 132,944.000 185,954.000 174,793.500	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 493,691.500 (40,788,792)	
韓国・ウォン	株 SK HYNIX INC POSCO SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD S-OIL CORP MANDO CORP SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	900 270 300 500 2,100 8,800	72,900.000 265,500.000 368,000.000 115,000.000 30,350.000 18,150.000	韓国・ウォン 65,610,000.000 71,685,000.000 110,400,000.000 57,500,000.000 63,735,000.000 159,720,000.000	

	POSCO DAEWOO CORP	4,144	19,150.000	79,357,600.000	
	LG CHEM LTD	200	327,500.000	65,500,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	2,800	47,800.000	133,840,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,150	44,300.000	449,645,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	300	200,000.000	60,000,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,316,992,600.000 (132,884,553)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	73,000	7.390	539,470.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	11,000	42.900	471,900.000	
	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	79,000	10.120	799,480.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	31,400	25.900	813,260.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,600	221.400	575,640.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,400	74.950	704,530.000	
	SINGAMAS CONTAINER HLDGS	704,000	1.240	872,960.000	
	AIA GROUP LTD	42,200	62.650	2,643,830.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	12,000	63.550	762,600.000	
	HKBN LTD	64,500	11.200	722,400.000	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	7,000	92.150	645,050.000	
	WYNN MACAU LTD	14,000	16.160	226,240.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 9,777,360.000 (142,260,587)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	TAIMED BIOLOGICS INC	7,000	158.000	1,106,000.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	92,000	51.000	4,692,000.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,080.000	3,080,000.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	94,000	73.200	6,880,800.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	26,000	69.100	1,796,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	54,000	231.000	12,474,000.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,000	30.950	5,199,600.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 35,229,000.000 (130,347,300)	
合計				660,671,794	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	27,600	オーストラリア・ドル 288,420.000	
		オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 288,420.000 (23,734,082)	
投資証券 合計				23,734,082 [23,734,082]	
合計				23,734,082 [23,734,082]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリア・ドル	株式 14銘柄	89.8%	10.2%	34.0%
	投資証券 1銘柄			
オフショア・人民元	株式 1銘柄	100%	-%	0.8%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	6.0%
韓国・ウォン	株式 11銘柄	100%	-%	19.4%
香港・ドル	株式 12銘柄	100%	-%	20.8%
台湾・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	19.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

財政状態計算書
2018年4月30日現在

米ドル

資産	
現金	69,262,703
借方勘定	18,289
金融資産(損益通算後の評価額)	451,340,914
資産合計	520,621,906
資本	
受益証券元本	571,749,859
剰余金	(62,576,154)
資本合計	509,173,705
負債	
当座借越	2,936,632
貸方勘定	428,515
金融負債(損益通算後の評価額)	8,083,054
負債合計	11,448,201
資本および負債合計	520,621,906

包括利益計算書
2018年4月30日に終了した年度

米ドル

収益	
利息収入	394,413
金融資産および負債(損益通算後の評価額)による純利益	61,765,513
純投資利益合計	62,159,926
費用	
運用会社報酬	3,656,152
管理会社報酬	664,751
受託会社報酬	44,320
保管会社報酬	66,481
仲介手数料	689,167
監査報酬	20,696
その他の費用	13,573
費用合計	5,155,140

当会計年度の営業利益	57,004,786
金融費用 支払利息	(22,438)
金融費用合計	(22,438)
包括利益合計	56,982,348

組入資産の明細
2018年4月30日現在

債券	元本	評価額 米ドル	純資産に 占める比率 (%)
米国			
US T-Bill 0% YLD 24-May-2018	43,000,000	42,965,230	8.44
US T-Bill 0% YLD 21-Jun-2018	47,000,000	46,910,266	9.21
US T-Bill 0% YLD 19-Jul-2018	49,000,000	48,848,491	9.59
US T-Bill 0% YLD 16-Aug-2018	51,000,000	50,788,162	9.97
US T-Bill 0% YLD 13-Sep-2018	50,000,000	49,696,672	9.76
US T-Bill 0% YLD 11-Oct-2018	44,000,000	43,672,280	8.58
US T-Bill 0% YLD 08-Nov-2018	45,000,000	44,601,089	8.76
US T-Bill 0% YLD 06-Dec-2018	43,000,000	42,526,534	8.35
US T-Bill 0% YLD 31-Jan-2019	40,000,000	39,402,639	7.74
US T-Bill 0% YLD 28-Feb-2019	25,000,000	24,568,750	4.83
債券合計		433,980,113	85.23

先物契約	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価(損) 米ドル
フランス				
Milling Wheat (EOP) - Sep-2018	970	9,968,264	-	(5,204)
Rapeseed (EOP) - Aug-2018	236	4,973,830	-	(72,277)
		14,942,094	-	(77,481)
日本				
Rubber (TCM) - Sep-2018	583	4,917,725	55,292	-
		4,917,725	55,292	-
英国				
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2018	624	42,075,160	3,969,800	-
Brent Crude Oil (ICE) - Aug-2018	301	22,048,250	-	-
Coffee Robusta (ICE) - Jul-2018	566	9,954,240	18,680	-
Copper Grade A (LME) - May-2018	111	19,298,513	-	(513,844)
Copper Grade A (LME) - May-2018	(111)	(18,746,281)	-	(38,388)
Copper Grade A (LME) - Jun-2018	(39)	(6,614,156)	-	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2018	118	19,962,581	49,481	-
Copper Grade A (LME) - Jul-2018	39	6,625,613	-	-
Gas Oil (ICE) - Jun-2018	64	3,881,600	276,800	-
Gas Oil (ICE) - Jul-2018	31	2,002,600	-	-
No. 7 Cocoa (LIF) - Jul-2018	193	4,714,702	323,184	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2018	370	19,803,919	795,831	-

Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2018	(370)	(18,302,338)	-	(2,297,413)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2018	388	19,256,700	2,340,350	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2018	(129)	(7,180,463)	-	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2018	119	6,628,300	-	-
Primary Nickel (LME) - May-2018	59	4,846,530	53,361	-
Primary Nickel (LME) - May-2018	(59)	(4,737,258)	-	(162,633)
Primary Nickel (LME) - Jun-2018	62	4,985,964	170,514	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2018	(20)	(1,663,380)	-	-
Primary Nickel (LME) - Jul-2018	20	1,665,600	-	-
Special High Grade Zinc (LME) - May-2018	112	9,655,275	-	(898,275)
Special High Grade Zinc (LME) - May-2018	(112)	(9,188,575)	431,575	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2018	(40)	(3,125,500)	-	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2018	120	9,844,000	-	(467,500)
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2018	43	3,356,150	-	-
Standard Lead (LME) - May-2018	153	9,585,119	-	(595,413)
Standard Lead (LME) - May-2018	(153)	(9,164,700)	174,994	-
Standard Lead (LME) - Jun-2018	(54)	(3,168,788)	-	-
Standard Lead (LME) - Jun-2018	162	9,699,075	-	(192,713)
Standard Lead (LME) - Jul-2018	58	3,401,338	-	-
Tin (LME) - May-2018	46	4,978,350	-	(152,950)
Tin (LME) - May-2018	(46)	(4,874,950)	49,550	-
Tin (LME) - Jun-2018	(16)	(1,676,800)	-	-
Tin (LME) - Jun-2018	47	4,977,925	-	(52,325)
Tin (LME) - Jul-2018	16	1,674,400	-	-
White Sugar (ICE) - Aug-2018	299	5,147,725	-	(250,105)
		161,626,440	8,654,120	(5,621,559)
米国				
Corn (CBT) - Jul-2018	1,223	24,241,463	126,813	-
Cotton No. 2 (NYB) - Jul-2018	509	20,792,995	714,800	-
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2018	137	2,883,413	278,205	-
Gasoline Rbob (NYM) - Jun-2018	116	9,623,494	743,635	-
Gasoline Rbob (NYM) - Jul-2018	57	5,077,913	-	-
Gold (CMX) - Jun-2018	123	16,206,560	71,260	-
Gold (CMX) - Aug-2018	64	8,510,080	-	-
Hard Red Spring Wheat (MGE) - Jul-2018	166	4,875,513	170,888	-
Heating Oil (NYM) - Jun-2018	70	5,834,548	440,294	-
Heating Oil (NYM) - Jul-2018	34	3,037,213	-	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2018	715	19,580,990	231,660	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2018	355	9,979,050	-	-
Lean Hogs (CME) - Jun-2018	107	3,412,780	-	(304,430)
Lean Hogs (CME) - Aug-2018	55	1,685,750	-	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2018	764	48,306,250	3,722,150	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2018	374	25,424,520	-	-
Live Cattle (CME) - Jun-2018	155	7,044,220	-	(410,220)
Live Cattle (CME) - Aug-2018	82	3,475,980	-	-
Lumber (CME) - Jul-2018	88	4,876,322	524,150	-
Milk Future (CME) - May-2018	11	316,600	14,940	-
Milk Future (CME) - Jun-2018	6	186,580	20	-
Oat (CBT) - Jul-2018	217	2,593,575	-	(76,375)
Palladium (NYM) - Jun-2018	10	1,010,935	-	(47,935)
Palladium (NYM) - Sep-2018	5	478,950	200	-
Platinum (NYM) - Jul-2018	193	9,430,580	-	(587,320)
Rough Rice (CBT) - Jul-2018	147	3,677,750	145,720	-
Silver (CMX) - Jul-2018	243	20,083,935	-	(40,080)
Soybean Meal (CBT) - Jul-2018	99	3,795,290	118,180	-
Soybean Oil (CBT) - Jul-2018	525	10,180,206	-	(500,256)
Soybeans (CBT) - Jul-2018	338	17,751,913	98,713	-
Sugar No. 11 World (NYB) - Jul-2018	371	5,204,192	-	(417,398)
Wheat (CBT) - Jul-2018	202	4,972,313	385,738	-
Wheat (CBT) - Jul-2018	581	13,617,400	864,023	-
		318,169,273	8,651,389	(2,384,014)

先物契約合計

499,655,532

17,360,801

(8,083,054)

投資明細

2018年11月12日現在における「ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド」が組入れている Daiwa “ RICI ” Fundの投資有価証券の状況を示しております。

(1) 有価証券

(単位: USドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US TREASURY BILL OPCT 28FEB19	55,000,000	54,642,402.82	
US TREASURY BILL OPCT 23MAY19	51,000,000	50,369,459.24	
US TREASURY BILL OPCT 06DEC18	50,000,000	49,930,666.85	
US TREASURY BILL OPCT 31JAN19	50,000,000	49,770,135.40	
TREASURY BILL OPCT 25APR19	50,000,000	49,480,096.03	
US TREASURY BILL OPCT 28MAR19	47,000,000	46,608,020.00	
US TREASURY BILL OPCT 04APR19	45,000,000	44,567,657.51	
US TREASURY BILL OPCT 18JUL19	44,000,000	43,240,111.32	
US TREASURY BILL OPC 20JUN19	40,000,000	39,416,235.68	
US TREASURY BILL 07MAR19	33,000,000	32,749,810.50	

(2) 商品先物

(単位: USドル)

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
MILLING WHEAT (EOP) MAR-19	買建	891	4,356.34	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-19	買建	243	7,898.55	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-19	買建	870	-3,266,340.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) JAN-19	買建	614	891,110.00	
COPPER GRADE A (LME) NOV-18	買建	136	739,475.00	
COPPER GRADE A (LME) NOV-18	売建	136	216,337.50	
COPPER GRADE A (LME) DEC-18	買建	134	-239,400.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-18	売建	134	-385,325.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-19	買建	134	389,875.00	
GAS OIL (ICE) JAN-19	買建	89	-172,575.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-19	買建	240	-117,617.72	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-18	買建	382	-1,159,818.75	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-18	売建	382	770,325.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-18	買建	406	-763,625.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-18	売建	406	-289,500.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-19	買建	418	291,075.00	
PRIMARY NICKEL (LME) NOV-18	買建	64	-431,505.00	

PRIMARY NICKEL (LME) NOV-18	売建	64	307,092.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-18	買建	68	-328,638.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-18	売建	68	-35,820.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-19	買建	73	38,790.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-18	買建	165	563,337.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-18	売建	165	143,962.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-18	買建	165	-220,687.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-18	売建	165	8,075.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-19	買建	158	-8,118.75	
STANDARD LEAD (LME) NOV-18	買建	199	-418,950.00	
STANDARD LEAD (LME) NOV-18	売建	199	160,981.25	
STANDARD LEAD (LME) DEC-18	買建	212	-127,518.75	
STANDARD LEAD (LME) DEC-18	売建	212	-334,987.50	
STANDARD LEAD (LME) JAN-19	買建	212	348,987.50	
TIN (LME) NOV-18	買建	55	93,720.00	
TIN (LME) NOV-18	売建	55	-121,150.00	
TIN (LME) DEC-18	買建	56	124,450.00	
TIN (LME) DEC-18	売建	56	-67,170.00	
TIN (LME) JAN-19	買建	54	63,810.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-19	買建	284	-136,285.00	
RUBBER (TCM) APR-19	買建	718	-107,825.11	
CORN (CBT) MAR-19	買建	1,296	518,475.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-19	買建	553	413,250.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) JAN-19	買建	149	-229,897.50	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) JAN-19	買建	203	-1,029,995.40	
GOLD (CMX) FEB-19	買建	210	-20,300.00	
HARD RED SPRING WHEAT (MGE) MAR-19	買建	177	20,862.50	
HEATING OIL (NYM) JAN-19	買建	97	-302,190.00	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) JAN-19	買建	952	2,659,860.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-19	買建	193	-436,650.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) JAN-19	買建	1,155	-5,002,300.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-19	買建	211	-203,270.00	
LUMBER (CME) JAN-19	買建	155	-30,690.00	
MILK FUTURE (CME) DEC-18	買建	17	-22,940.00	
OAT (CBT) MAR-19	買建	184	61,900.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-19	買建	14	70,250.00	
PLATINUM (NYM) JAN-19	買建	223	911,865.00	
ROUGH RICE (CBT) JAN-19	買建	183	196,820.00	
SILVER (CMX) MAR-19	買建	284	-108,955.00	

SOYBEAN MEAL (CBT) JAN-19	買建	125	-25,340.00	
SOYBEAN OIL (CBT) JAN-19	買建	614	-42,840.00	
SOYBEANS (CBT) JAN-19	買建	425	263,587.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-19	買建	342	546,168.00	
WHEAT (CBT) MAR-19	買建	196	-17,925.00	
WHEAT (CBT) MAR-19	買建	541	27,450.00	

(注) L M E (ロンドン金属取引所)においては、先渡し売買となるため、期日到来まで反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2018年11月30日

資産総額	1,233,998,795円
負債総額	967,027円
純資産総額（ - ）	1,233,031,768円
発行済数量	1,534,539,424口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8035円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	249,220,327,928円
負債総額	55,532,204円
純資産総額（ - ）	249,164,795,724円
発行済数量	198,726,528,316口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2538円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	29,136,861,541円
負債総額	28,014,370円
純資産総額（ - ）	29,108,847,171円
発行済数量	17,305,239,950口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6821円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	19,496,920,127円
負債総額	471,023,133円
純資産総額（ - ）	19,025,896,994円
発行済数量	6,858,439,975口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.7741円

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	2,318,727,690円
負債総額	1,000,717円
純資産総額（ - ）	2,317,726,973円
発行済数量	871,405,053口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.6598円

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	1,227,014,836円
負債総額	346円
純資産総額（ - ）	1,227,014,490円
発行済数量	771,652,974口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5901円

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2018年11月30日

資産総額	797,867,064円
負債総額	36,750,629円
純資産総額（ - ）	761,116,435円
発行済数量	398,109,551口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9118円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(8) 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2018年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	169,949
追加型株式投資信託	721	15,412,596
株式投資信託 合計	802	15,582,545
単位型公社債投資信託	30	115,193
追加型公社債投資信託	14	1,407,605
公社債投資信託 合計	44	1,522,798
総合計	846	17,105,344

3 【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第60期事業年度に係る中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1 229	1 213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066

投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2	2
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973

賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(平成29年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

当事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設

けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されており、

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
(2) その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	122	55	67
(2) その他 証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	1,829	1,926	96

小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

3. 売却した其他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	50	-	1
(2) その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円

その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（平成29年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,685	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)		当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2018年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,097
有価証券		0
未収委託者報酬		12,445
その他		2,329
流動資産合計		35,872
固定資産		
有形固定資産	1	199
無形固定資産		
ソフトウェア		2,162
その他		449
無形固定資産合計		2,612
投資その他の資産		
投資有価証券		7,521
関係会社株式		1,836
繰延税金資産		964
その他		1,286
投資その他の資産合計		11,608
固定資産合計		14,420
資産合計		50,293

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2018年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,165
未払費用		3,666

未払法人税等	859
賞与引当金	611
その他	2
流動負債合計	12,855
固定負債	
退職給付引当金	2,335
役員退職慰労引当金	144
その他	3
固定負債合計	2,483
負債合計	15,338
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,643
利益剰余金合計	8,017
株主資本合計	34,687
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	34,955
負債・純資産合計	50,293

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	39,713
その他営業収益	351
営業収益合計	40,065
営業費用	
支払手数料	18,868
その他営業費用	6,357

営業費用合計		25,226
一般管理費	1	5,925
営業利益		8,913
営業外収益	2	418
営業外費用	3	86
経常利益		9,244
特別利益		-
特別損失	4	29
税引前中間純利益		9,215
法人税、住民税及び事業税		2,628
法人税等調整額		125
中間純利益		6,462

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414
会計方針の変更による累積的影響額				480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
中間純利益	-	-	-	6,462	6,462	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,207	6,207	6,207
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,643	8,017	34,687

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	40,631
会計方針の変更による累積的影響額			480
会計方針の変更を反映した当期首残高			41,112
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
中間純利益	-	-	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	50	50	50
当中間期変動額合計	50	50	6,156
当中間期末残高	267	267	34,955

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年間)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の期首残高が480百万円増加しております。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

当中間会計期間

(2018年9月30日現在)

有形固定資産	280百万円
--------	--------

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

3 保証債務

当中間会計期間(2018年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,743百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	436百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還益	132百万円
投資有価証券売却益	124百万円
為替差益	104百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還損	32百万円
投資有価証券売却損	24百万円
固定資産除却損	13百万円

4 特別損失の主要項目

当中間会計期間

(自 2018年4月1日
至 2018年9月30日)

関係会社整理損失

29百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年3月31日	2018年6月26日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2018年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)参照のこと)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	21,097	21,097	-
(2) 未収委託者報酬	12,445	12,445	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,551	6,551	-
資産合計	40,094	40,094	-
(1) 未払金	(7,096)	(7,096)	-
(2) 未払費用(*2)	(3,089)	(3,089)	-
負債合計	(10,186)	(10,186)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金及び（2）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（3）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

（1）未払金及び（2）未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	1,836
差入保証金	1,071

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（2018年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	129	55	74
（2）その他			

証券投資信託	4,148	3,765	383
小計	4,277	3,820	457
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他			
証券投資信託	2,274	2,378	104
小計	2,274	2,378	104
合計	6,551	6,198	352

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,400.41円
1株当たり中間純利益	2,477.30円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,462
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,462
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (平成2018年3月 末日現在)	事業の内容
九州 F G 証券株式会社	3,000	(注1)
株式会社鹿兒島銀行	18,130	(注2)

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

< 参考 >

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 511千米ドル（約57百万円）（2017年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 アムンディ・アイルランド・リミテッド

資本金の額 1,032,912ユーロ（約139百万円）（2017年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年12月14日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンドの平成30年5月11日から平成30年11月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンドの平成30年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。