

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2019年12月27日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社  
（2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会  
社（予定））

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松下 浩一

【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】 西脇 保宏  
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】 常陽3分法ファンド

【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。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年6月28日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

## 第一部 【証券情報】

### (5) 【申込手数料】

<更新後>

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、2.2%（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。

<略>

## 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】

#### (3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（2019年10月末日現在）>

<略>

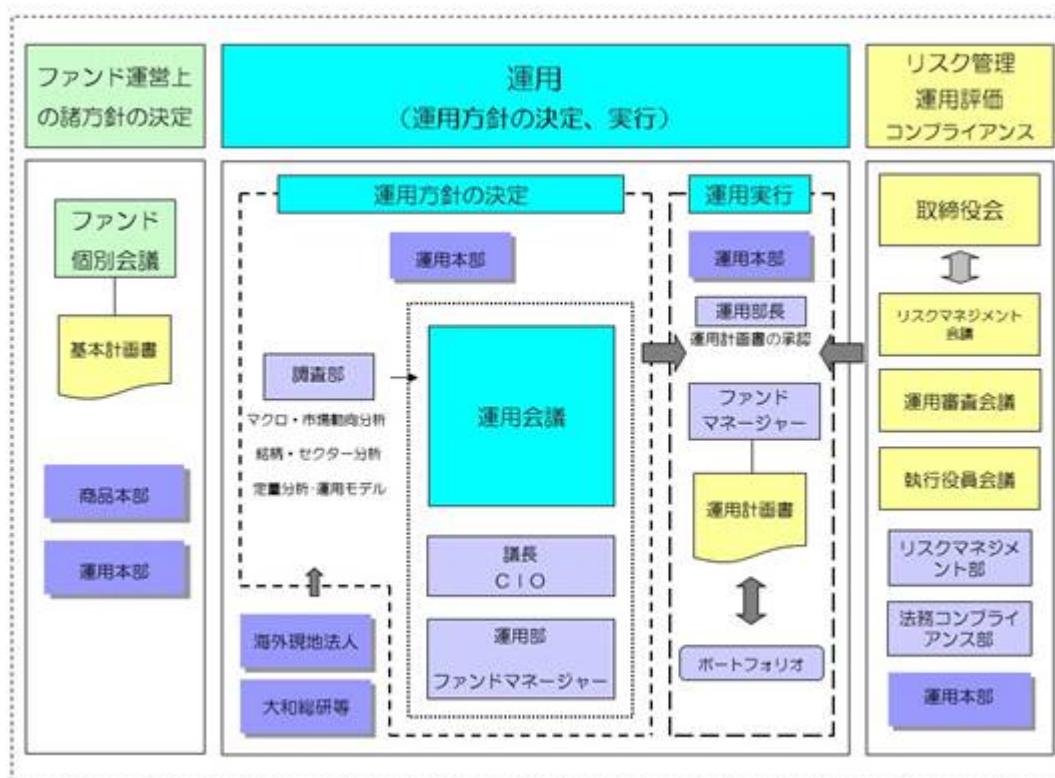
#### 2 【投資方針】

#### (3) 【運用体制】

<更新後>

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。



<略>

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30～40名程度です。

#### イ．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。

#### ロ．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。

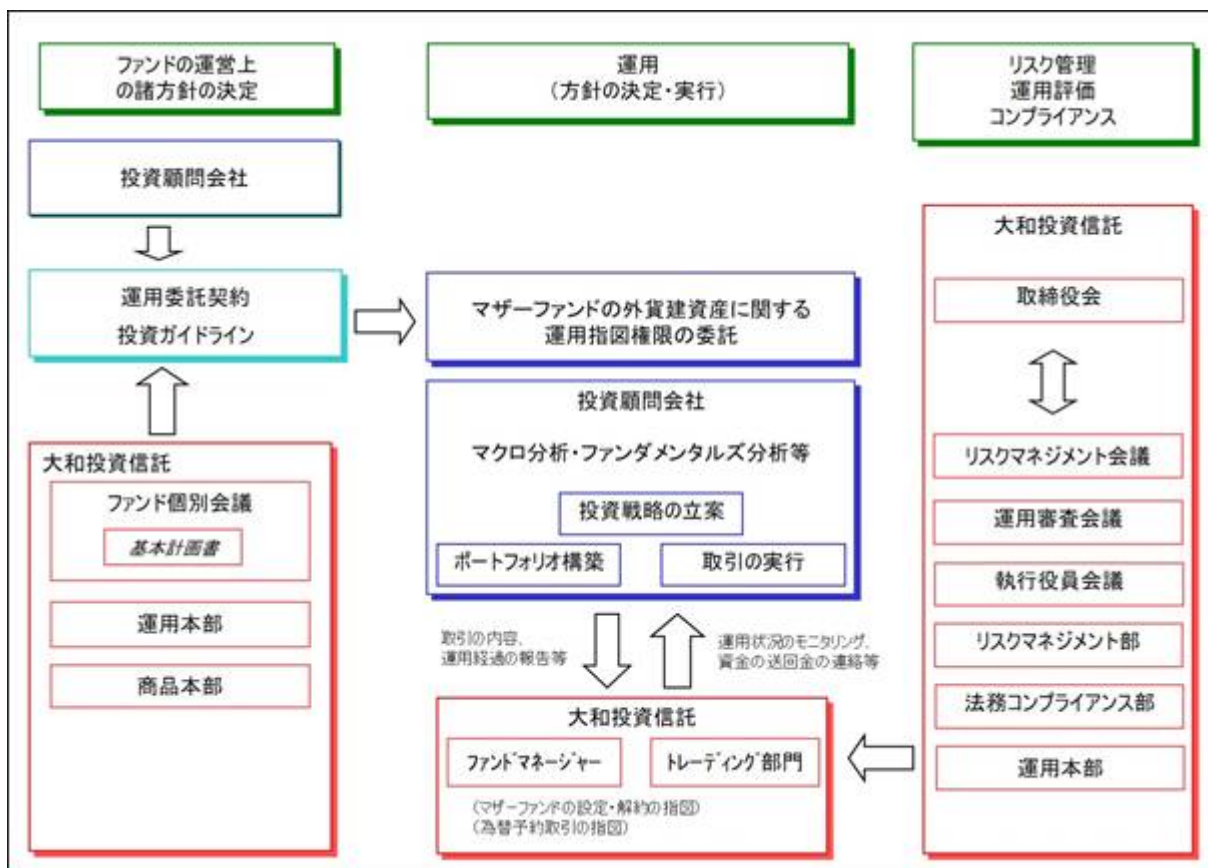
#### ハ．執行役員会議

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。

< 略 >

海外リート部分にかかる運用体制について

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにかかるものを含みます。）



< 略 >

上記の運用体制は2019年10月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

### 3 【投資リスク】

< 更新後 >

&lt; 略 &gt;

## 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。

&lt; 略 &gt;

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

&lt; 更新後 &gt;

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、2.2%（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。

&lt; 略 &gt;

### (3) 【信託報酬等】

&lt; 更新後 &gt;

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1.056%（税抜0.96%）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。

&lt; 略 &gt;

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1.265% (税抜1.15%) 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。 )。

< 略 >

(5) 【課税上の取扱い】

< 更新後 >

< 略 >

- ( ) 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2019年10月末現在のものでありますので、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。

< 略 >

## 5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

## (1) 【投資状況】（2019年10月31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	495,220,870	33.38
内 日本	495,220,870	33.38
親投資信託受益証券	983,575,702	66.29
内 日本	983,575,702	66.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,903,504	0.33
純資産総額	1,483,700,076	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】（2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワいばらきファンド	日本	投資信託 受益証券	421,356,990	1.0944 461,133,090	1.1753 495,220,870	33.38
2	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	179,342,108	2.6256 470,880,640	2.7565 494,356,520	33.32
3	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	60,044,035	2.6339 158,149,983	2.7270 163,740,083	11.04
4	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	92,437,495	1.7279 159,722,747	1.7681 163,438,734	11.02
5	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	100,777,639	1.5912 160,357,379	1.6079 162,040,365	10.92

(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	33.38%
親投資信託受益証券	66.29%
合計	99.67%

(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7特定期間末 (2010年4月5日)	9,574,724,045	9,597,392,002	0.6336	0.6351
第8特定期間末 (2010年10月5日)	7,914,683,574	7,935,273,911	0.5766	0.5781
第9特定期間末 (2011年4月5日)	7,213,424,709	7,231,407,530	0.6017	0.6032
第10特定期間末 (2011年10月5日)	5,227,120,484	5,242,531,048	0.5088	0.5103
第11特定期間末 (2012年4月5日)	5,078,281,285	5,086,901,026	0.5891	0.5901
第12特定期間末 (2012年10月5日)	4,264,921,925	4,272,432,586	0.5678	0.5688
第13特定期間末 (2013年4月5日)	4,792,795,017	4,799,378,842	0.7280	0.7290
第14特定期間末 (2013年10月7日)	4,243,205,683	4,249,122,889	0.7171	0.7181
第15特定期間末 (2014年4月7日)	4,101,385,313	4,106,653,568	0.7785	0.7795
第16特定期間末 (2014年10月6日)	3,728,720,234	3,733,239,931	0.8250	0.8260
第17特定期間末 (2015年4月6日)	3,301,274,965	3,304,704,157	0.9627	0.9637
第18特定期間末 (2015年10月5日)	2,615,608,522	2,618,530,086	0.8953	0.8963
第19特定期間末 (2016年4月5日)	2,286,635,219	2,289,318,184	0.8523	0.8533
第20特定期間末 (2016年10月5日)	2,100,496,290	2,103,039,877	0.8258	0.8268
第21特定期間末 (2017年4月5日)	2,039,358,888	2,041,659,305	0.8865	0.8875
第22特定期間末 (2017年10月5日)	2,003,620,028	2,005,726,094	0.9514	0.9524
第23特定期間末 (2018年4月5日)	1,681,827,590	1,683,650,383	0.9227	0.9237

第24特定期間末 (2018年10月5日)	1,640,553,399	1,642,265,297	0.9583	0.9593
2018年10月末日	1,547,014,355	-	0.9182	-
11月末日	1,570,272,553	-	0.9390	-
12月末日	1,455,203,937	-	0.8751	-
2019年1月末日	1,503,478,231	-	0.9097	-
2月末日	1,528,829,411	-	0.9322	-
3月末日	1,523,435,559	-	0.9365	-
第25特定期間末 (2019年4月5日)	1,545,209,106	1,546,835,758	0.9499	0.9509
4月末日	1,507,301,588	-	0.9417	-
5月末日	1,452,717,206	-	0.9102	-
6月末日	1,463,735,615	-	0.9229	-
7月末日	1,464,262,471	-	0.9277	-
8月末日	1,420,661,773	-	0.9056	-
9月末日	1,455,361,428	-	0.9461	-
第26特定期間末 (2019年10月7日)	1,436,557,518	1,438,094,945	0.9344	0.9354
10月末日	1,483,700,076	-	0.9791	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第7特定期間	0.0090
第8特定期間	0.0090
第9特定期間	0.0090
第10特定期間	0.0090
第11特定期間	0.0080
第12特定期間	0.0060
第13特定期間	0.0060
第14特定期間	0.0060
第15特定期間	0.0060
第16特定期間	0.0060
第17特定期間	0.0060
第18特定期間	0.0060
第19特定期間	0.0060
第20特定期間	0.0060
第21特定期間	0.0060
第22特定期間	0.0060
第23特定期間	0.0060
第24特定期間	0.0060
第25特定期間	0.0060
第26特定期間	0.0060

(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7特定期間	13.2
第8特定期間	7.6
第9特定期間	5.9

第10特定期間	13.9
第11特定期間	17.4
第12特定期間	2.6
第13特定期間	29.3
第14特定期間	0.7
第15特定期間	9.4
第16特定期間	6.7
第17特定期間	17.4
第18特定期間	6.4
第19特定期間	4.1
第20特定期間	2.4
第21特定期間	8.1
第22特定期間	8.0
第23特定期間	2.4
第24特定期間	4.5
第25特定期間	0.3
第26特定期間	1.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第7特定期間	92,266,297	1,626,510,868
第8特定期間	79,177,156	1,464,257,071
第9特定期間	75,268,753	1,813,612,902
第10特定期間	65,032,008	1,779,870,066
第11特定期間	58,801,700	1,712,769,168
第12特定期間	35,076,258	1,144,156,758
第13特定期間	41,349,897	968,185,791
第14特定期間	31,269,783	697,888,697
第15特定期間	22,981,899	671,933,060
第16特定期間	19,302,807	767,860,582
第17特定期間	16,718,023	1,107,222,970
第18特定期間	11,537,449	519,165,708
第19特定期間	15,541,478	254,140,657
第20特定期間	8,306,281	147,684,454
第21特定期間	8,399,451	251,568,721
第22特定期間	7,161,244	201,512,964
第23特定期間	7,582,252	290,854,869
第24特定期間	10,530,683	121,425,348
第25特定期間	7,402,250	92,648,841
第26特定期間	4,897,291	94,121,731

(参考) 投資信託証券

( FOFs専用 ) ダイワいばらきファンド ( 適格機関投資家専用 )

## (1) 投資状況 (2019年10月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	493,185,691	99.80

	内 日本	493,185,691	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		990,456	0.20
純資産総額		494,176,147	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 (2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	茨城マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	190,507,452	2.3470 447,139,446	2.5888 493,185,691	99.80

(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
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

(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。

#### 参考情報 マザーファンド

##### 茨城マザーファンド

## (1) 投資状況 (2019年10月31日現在)

### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	4,293,126,460	93.40
内 日本	4,293,126,460	93.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	303,246,663	6.60
純資産総額	4,596,373,123	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)	283,645,000	6.17

内 日本	283,645,000	6.17
------	-------------	------

(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 (2019年10月31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	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	信越化学	日本	株式	化学	20,300	11,090.00 225,127,000	12,160.00 246,848,000	5.37
2	ダイキン工業	日本	株式	機械	13,900	13,670.00 190,013,000	15,230.00 211,697,000	4.61
3	ファナック	日本	株式	電気機器	9,700	19,265.00 186,870,500	21,600.00 209,520,000	4.56
4	花王	日本	株式	化学	23,200	8,300.00 192,560,000	8,744.00 202,860,800	4.41
5	キャノン	日本	株式	電気機器	63,400	3,036.00 192,482,400	2,962.00 187,790,800	4.09
6	日立	日本	株式	電気機器	46,000	3,830.00 176,180,000	4,069.00 187,174,000	4.07
7	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	42,100	3,764.00 158,464,400	4,100.00 172,610,000	3.76
8	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	89,700	1,523.50 136,657,950	1,858.50 166,707,450	3.63
9	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	63,400	2,437.00 154,505,800	2,456.00 155,710,400	3.39
10	S M C	日本	株式	機械	3,200	40,860.00 130,752,000	47,190.00 151,008,000	3.29
11	ケーズホールディングス	日本	株式	小売業	111,800	1,006.00 112,470,800	1,239.00 138,520,200	3.01
12	アサヒグループホールディング	日本	株式	食料品	23,000	4,669.00 107,387,000	5,430.00 124,890,000	2.72
13	大和ハウス	日本	株式	建設業	31,700	3,077.00 97,540,900	3,735.00 118,399,500	2.58
14	小松製作所	日本	株式	機械	46,200	2,440.50 112,751,100	2,559.00 118,225,800	2.57
15	エーザイ	日本	株式	医薬品	14,100	5,798.00 81,751,800	7,887.00 111,206,700	2.42
16	クボタ	日本	株式	機械	58,500	1,673.50 97,899,750	1,732.00 101,322,000	2.20
17	キリンHD	日本	株式	食料品	43,400	2,366.00 102,684,400	2,305.00 100,037,000	2.18
18	積水ハウス	日本	株式	建設業	32,800	1,878.50 61,614,800	2,342.00 76,817,600	1.67

19	日本製鉄	日本	株式	鉄鋼	45,200	1,721.50 77,811,800	1,591.50 71,935,800	1.57
20	ジョイフル本田	日本	株式	小売業	49,100	1,252.00 61,473,200	1,384.00 67,954,400	1.48
21	東レ	日本	株式	繊維製品	77,500	757.50 58,706,250	770.70 59,729,250	1.30
22	三菱ケミカルHLDGS	日本	株式	化学	71,600	726.90 52,046,040	830.60 59,470,960	1.29
23	明治ホールディングス	日本	株式	食料品	7,300	7,630.00 55,699,000	7,820.00 57,086,000	1.24
24	日本電気	日本	株式	電気機器	12,400	4,555.00 56,482,000	4,300.00 53,320,000	1.16
25	安川電機	日本	株式	電気機器	12,700	3,615.00 45,910,500	4,180.00 53,086,000	1.15
26	ヤクルト	日本	株式	食料品	8,100	6,530.00 52,893,000	6,220.00 50,382,000	1.10
27	大日本印刷	日本	株式	その他製品	15,400	2,354.00 36,251,600	2,908.00 44,783,200	0.97
28	日立ハイテクノロジーズ	日本	株式	卸売業	6,500	5,660.00 36,790,000	6,760.00 43,940,000	0.96
29	積水化学	日本	株式	化学	23,000	1,566.00 36,018,000	1,899.00 43,677,000	0.95
30	A G C	日本	株式	ガラス・土石製品	10,800	3,645.00 39,366,000	3,830.00 41,364,000	0.90

(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	93.40%
合計	93.40%

(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	5.28%
食料品	13.88%
繊維製品	1.30%
パルプ・紙	0.22%
化学	17.07%
医薬品	7.76%
ゴム製品	0.43%
ガラス・土石製品	0.90%
鉄鋼	2.71%
非鉄金属	0.42%
金属製品	0.36%
機械	13.29%
電気機器	15.03%
輸送用機器	0.92%
精密機器	0.62%
その他製品	1.67%
情報・通信業	0.04%

卸売業	0.96%
小売業	9.43%
銀行業	1.10%
不動産業	0.01%
合計	93.40%

(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 2019年12月	買建	17	262,404,180	283,645,000	6.17%

(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。

#### (参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2019年10月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	91,472,661,335	96.29
内 香港	3,509,843,664	3.69
内 シンガポール	6,172,472,788	6.50
内 イギリス	8,640,700,394	9.10
内 オランダ	419,850,953	0.44
内 ベルギー	2,212,923,964	2.33
内 フランス	7,703,695,018	8.11
内 ドイツ	625,665,760	0.66
内 スペイン	1,188,926,030	1.25
内 カナダ	3,222,288,038	3.39
内 アメリカ	45,784,520,098	48.20
内 オーストラリア	10,855,352,575	11.43
内 ニューージーランド	1,136,422,053	1.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,522,815,118	3.71
純資産総額	94,995,476,453	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)	28,920,271	0.03

	内 日本	28,920,271	0.03
為替予約取引(売建)		464,378,244	0.49
	内 日本	464,378,244	0.49

(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 (2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	UDR INC	アメリカ	投資証券	727,354	5,250.95 3,819,307,047	5,483.19 3,988,225,125	4.20
2	KLEPIERRE	フランス	投資証券	884,362	3,636.87 3,216,322,216	4,061.62 3,591,944,509	3.78
3	LINK REIT	香港	投資証券	2,946,805	1,234.82 3,638,776,697	1,191.06 3,509,843,664	3.69
4	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	94,697	35,309.78 3,343,730,615	35,674.53 3,378,271,157	3.56
5	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	325,005	9,278.75 3,015,641,314	9,546.59 3,102,692,213	3.27
6	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,855,825	1,024.86 2,926,900,130	1,073.49 3,065,707,576	3.23
7	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	48,588	61,513.49 2,988,818,729	62,187.90 3,021,585,724	3.18
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	302,480	9,464.93 2,862,954,567	9,849.28 2,979,211,666	3.14
9	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,322,741	228.85 2,362,371,665	243.90 2,517,790,854	2.65
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	273,424	8,094.57 2,213,266,402	8,921.62 2,439,386,996	2.57
11	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	13,246,041	142.57 1,889,088,408	158.41 2,098,435,166	2.21
12	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,610,706	1,074.23 1,730,278,274	1,195.96 1,926,355,345	2.03
13	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	シンガポール	投資証券	9,377,035	188.34 1,766,618,781	203.22 1,905,651,689	2.01
14	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	5,759,665	294.49 1,696,284,068	319.18 1,838,411,344	1.94
15	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	6,956,377	244.51 1,701,093,809	259.23 1,803,318,305	1.90
16	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	4,319.28 1,742,262,965	4,429.21 1,786,602,991	1.88
17	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,081,841	834.93 1,738,259,971	849.15 1,767,812,773	1.86
18	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	107,314	16,831.65 1,806,277,324	16,460.47 1,766,439,779	1.86



19	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	673,625	2,406.24 1,620,908,809	2,612.03 1,759,529,517	1.85
20	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	11,895,590	134.75 1,602,945,027	140.02 1,665,630,028	1.75
21	COVIVIO	フランス	投資証券	129,975	11,417.24 1,483,955,769	12,303.89 1,599,199,143	1.68
22	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	480,383	3,069.32 1,474,452,608	3,316.48 1,593,182,918	1.68
23	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	188,705	8,142.04 1,536,444,866	8,120.27 1,532,335,626	1.61
24	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	イギリス	投資証券	4,464,738	296.88 1,325,678,103	329.21 1,469,858,452	1.55
25	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	82,789	16,011.89 1,325,608,593	17,461.08 1,445,585,816	1.52
26	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	397,407	3,624.20 1,440,283,443	3,612.63 1,435,685,047	1.51
27	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	364,754	3,599.35 1,312,894,715	3,864.15 1,409,464,607	1.48
28	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	111,367	12,752.02 1,420,154,835	12,069.34 1,344,127,079	1.41
29	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	224,920	5,614.94 1,262,912,665	5,944.84 1,337,115,212	1.41
30	GECINA SA	フランス	投資証券	71,740	16,980.10 1,218,152,948	18,559.08 1,331,428,973	1.40

(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
投資証券	96.29%
合計	96.29%

(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

(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	シンガポール・ドル買/円 売 2019年11月	買建	61,648	4,925,709	4,931,861	0.01%
		米ドル買/円売 2019年11 月	買建	220,340	24,092,987	23,988,410	0.03%
		ユーロ売/円買 2019年11 月	売建	198,362	24,092,987	24,092,987	0.03%
		米ドル売/円買 2019年11 月	売建	4,045,240	440,295,709	440,285,257	0.46%

(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。

## ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

### (1) 投資状況 (2019年10月31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		17,524,536,508	57.01
	内 アメリカ	17,524,536,508	57.01
特殊債券		551,531,640	1.79
	内 アメリカ	551,531,640	1.79
社債券		11,803,683,473	38.40
	内 アメリカ	11,803,683,473	38.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		859,375,994	2.80
純資産総額		30,739,127,615	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 (2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 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	39,500,000	101.10 4,348,118,614	100.98 4,342,907,448	2.750000 2020/09/30	14.13
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	30,000,000	100.89 3,295,580,690	100.27 3,275,317,272	1.750000 2022/04/30	10.66
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	20,000,000	100.87 2,196,566,896	100.01 2,177,839,536	1.625000 2022/11/15	7.08
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	17,000,000	111.53 2,064,394,197	104.53 1,934,975,074	2.500000 2046/05/15	6.29
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	18,000,000	100.71 1,973,754,864	98.67 1,933,793,726	1.500000 2026/08/15	6.29
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000,000	106.05 1,732,073,928	103.71 1,693,791,720	2.250000 2027/02/15	5.51
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,500,000	145.43 1,345,990,347	137.89 1,276,144,372	4.375000 2041/05/15	4.15
8	RABOBANK NEDERLAND	アメリカ	社債券	10,500,000	103.34 1,181,458,513	102.99 1,177,468,605	4.500000 2021/01/11	3.83
9	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The	アメリカ	社債券	10,000,000	101.67 1,107,059,176	101.51 1,105,327,984	2.850000 2021/09/08	3.60
10	Toronto-Dominion Bank/The	アメリカ	社債券	10,000,000	100.48 1,094,069,792	100.33 1,092,425,704	2.125000 2021/04/07	3.55

11	Sumitomo Mitsui Banking Corp	アメリカ	社債券	9,000,000	107.14 1,049,974,480	105.86 1,037,411,906	3.950000 2023/07/19	3.37
12	AUST & NZ BANK	アメリカ	社債券	9,135,000	101.05 1,005,092,135	100.63 1,000,914,737	5.100000 2020/01/13	3.26
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	111.93 914,077,542	108.96 889,767,360	2.875000 2028/08/15	2.89
14	HSBC Bank PLC	アメリカ	社債券	7,000,000	101.96 777,166,930	101.71 775,208,179	4.125000 2020/08/12	2.52
15	National Australia Bank Ltd/New York	アメリカ	社債券	6,000,000	102.42 669,089,376	101.65 664,091,784	2.800000 2022/01/10	2.16
16	Total Capital SA	アメリカ	社債券	5,000,000	103.17 561,706,476	102.66 558,908,260	4.125000 2021/01/28	1.82
17	Sumitomo Mitsui Banking Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	103.26 562,147,440	102.52 558,135,212	3.200000 2022/07/18	1.82
18	Total Capital International SA	アメリカ	社債券	5,000,000	102.73 559,262,120	102.18 556,273,364	2.700000 2023/01/25	1.81
19	Chevron Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	101.96 555,092,016	101.38 551,945,384	2.355000 2022/12/05	1.80
20	Temasek Financial I Ltd	アメリカ	特殊債券	5,000,000	102.20 556,409,464	101.31 551,531,640	2.375000 2023/01/23	1.79
21	Royal Bank of Canada	アメリカ	社債券	5,000,000	100.28 545,951,540	100.12 545,096,832	2.100000 2020/10/14	1.77
22	Wells Fargo Bank NA	アメリカ	社債券	5,000,000	100.01 544,481,660	100.02 544,519,768	2.150000 2019/12/06	1.77
23	Microsoft Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	99.92 543,991,700	99.66 542,549,040	1.550000 2021/08/08	1.77
24	COMMONWEALTH BK AUSTR NY	アメリカ	社債券	4,000,000	100.62 438,246,355	100.51 437,745,507	2.400000 2020/11/02	1.42
25	RABOBANK NEDERLAND	アメリカ	社債券	3,000,000	100.93 329,697,350	100.57 328,501,848	4.750000 2020/01/15	1.07
26	United Overseas Bank Ltd	アメリカ	社債券	3,000,000	100.14 327,126,693	100.15 327,159,357	2.500000 2020/03/18	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
国債証券	57.01%
特殊債券	1.79%
社債券	38.40%
合計	97.20%

(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。

## ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

## (1) 投資状況 (2019年10月31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	1,208,267,487	11.06
内 オーストラリア	1,208,267,487	11.06
地方債証券	592,263,142	5.42
内 オーストラリア	592,263,142	5.42
特殊債券	7,125,295,843	65.24
内 オーストラリア	7,125,295,843	65.24
社債券	1,811,383,326	16.59
内 オーストラリア	1,811,383,326	16.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	184,180,813	1.69
純資産総額	10,921,390,611	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(売建)	45,160,000	0.41
内 日本	45,160,000	0.41

(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 (2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 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	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	10,000,000	112.93 850,189,736	112.32 845,582,600	3.250000 2026/07/21	7.74
2	EUROPEAN INVESTMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	9,500,000	116.40 832,481,998	116.00 829,649,964	4.750000 2024/08/07	7.60
3	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	10,000,000	100.51 756,646,808	100.43 756,052,096	2.750000 2020/02/03	6.92
4	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	オーストラリア	特殊債券	8,000,000	116.40 701,037,472	115.90 698,014,227	5.000000 2024/03/19	6.39
5	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	8,000,000	113.18 681,621,254	112.55 677,869,299	3.250000 2025/04/21	6.21
6	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	6,500,000	121.85 596,246,206	121.22 593,173,276	5.750000 2024/07/22	5.43
7	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	7,000,000	103.05 543,058,628	102.78 541,614,757	2.700000 2021/08/18	4.96

8	University of Sydney	オーストラリア	社債券	6,000,000	112.51 508,198,718	111.76 504,838,219	3.750000 2025/08/28	4.62
9	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY	オーストラリア	地方債証券	5,000,000	113.29 426,446,144	112.74 424,372,180	4.000000 2024/05/22	3.89
10	South Australia GOV.FIN.AUTH.	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	112.54 423,619,380	111.84 420,984,580	3.000000 2028/05/24	3.85
11	LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	110.63 416,426,376	110.28 415,116,504	5.500000 2022/03/29	3.80
12	NORDIC INVESTMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	109.60 412,564,512	109.22 411,122,900	5.000000 2022/04/19	3.76
13	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	4,500,000	120.01 406,552,651	118.98 403,060,035	3.250000 2029/04/21	3.69
14	Commonwealth Bank of Australia	オーストラリア	社債券	5,000,000	104.53 393,465,976	104.20 392,227,620	3.250000 2022/01/17	3.59
15	Australian National University	オーストラリア	社債券	4,040,000	113.84 346,232,082	113.06 343,868,982	3.980000 2025/11/18	3.15
16	Airservices Australia	オーストラリア	特殊債券	4,400,000	103.97 344,405,096	103.69 343,480,959	4.750000 2020/11/19	3.15
17	WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	111.57 251,980,980	110.92 250,513,020	3.000000 2026/10/21	2.29
18	ASIAN DEVELOPMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	109.30 246,854,412	108.94 246,041,388	5.000000 2022/03/09	2.25
19	LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	104.51 236,034,417	104.24 235,420,132	2.700000 2022/09/05	2.16
20	INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	102.23 230,894,299	102.00 230,374,867	2.800000 2021/01/13	2.11
21	Airservices Australia	オーストラリア	特殊債券	2,860,000	104.59 225,202,483	104.21 224,373,575	2.750000 2023/05/15	2.05
22	University Of Melbourne	オーストラリア	社債券	2,400,000	105.31 190,278,330	104.96 189,649,591	4.250000 2021/06/30	1.74
23	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY	オーストラリア	地方債証券	2,000,000	112.27 169,045,756	111.51 167,890,961	3.000000 2028/04/18	1.54
24	Toronto-Dominion Bank/The	オーストラリア	社債券	1,800,000	101.28 137,250,646	100.78 136,571,771	2.050000 2024/07/10	1.25
25	Westpac Banking Corp	オーストラリア	社債券	1,400,000	106.10 111,827,235	105.69 111,396,182	3.200000 2023/03/06	1.02
26	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	900,000	130.42 88,365,546	128.20 86,863,484	3.000000 2047/03/21	0.80
27	Macquarie University	オーストラリア	社債券	1,000,000	114.14 85,929,108	113.01 85,080,703	3.500000 2028/09/07	0.78
28	COUNCIL OF EUROPE	オーストラリア	特殊債券	1,065,000	104.83 84,050,375	104.50 83,780,994	6.000000 2020/10/08	0.77
29	Bank of Nova Scotia/Australia	オーストラリア	社債券	600,000	106.15 47,948,993	105.71 47,750,254	3.200000 2023/09/07	0.44
30	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	500,000	107.90 40,616,194	107.53 40,474,668	5.750000 2021/05/15	0.37

(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	11.06%

地方債証券	5.42%
特殊債券	65.24%
社債券	16.59%
合計	98.31%

(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

(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	豪ドル売/円買 2019年11月	売建	600,000	44,947,640	45,160,000	0.41%

(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。

#### ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

##### (1) 投資状況 (2019年10月31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	19,035,021,432	12.44
内 カナダ	19,035,021,432	12.44
地方債証券	61,808,496,056	40.38
内 カナダ	61,808,496,056	40.38
特殊債券	11,094,239,261	7.25
内 カナダ	11,094,239,261	7.25
社債券	57,966,353,671	37.87
内 カナダ	57,966,353,671	37.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,155,667,586	2.06
純資産総額	153,059,778,006	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(売建)	578,340,000	0.38
内 日本	578,340,000	0.38

(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（2019年10月31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	数 種類 は	株数、口 また 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	BRITISH COLUMBIA	カナダ	地方債証券	89,400,000	122.53 9,054,074,757	119.45 8,826,496,329	9.500000 2022/06/09	5.77
2	Ontario Electricity Financial Corp	カナダ	社債券	88,681,000	119.51 8,759,980,169	115.96 8,499,416,989	10.125000 2021/10/15	5.55
3	Province of Quebec Canada	カナダ	地方債証券	92,000,000	101.71 7,734,357,246	103.09 7,839,365,724	2.500000 2026/09/01	5.12
4	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	83,000,000	106.94 7,336,373,527	107.01 7,341,244,092	3.500000 2024/06/02	4.80
5	Province of Alberta Canada	カナダ	地方債証券	78,000,000	99.59 6,420,332,997	100.74 6,494,405,580	2.200000 2026/06/01	4.24
6	Province of Quebec Canada	カナダ	地方債証券	71,000,000	106.15 6,229,158,588	105.12 6,168,951,369	4.250000 2021/12/01	4.03
7	Ontario Electricity Financial Corp	カナダ	社債券	60,274,000	121.83 6,069,388,525	119.06 5,931,596,194	8.900000 2022/08/18	3.88
8	Toronto-Dominion Bank/The	カナダ	社債券	70,000,000	101.21 5,855,851,680	101.09 5,848,735,515	2.621000 2021/12/22	3.82
9	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	70,000,000	99.13 5,735,281,860	100.15 5,794,583,235	1.500000 2026/06/01	3.79
10	Toronto-Dominion Bank/The	カナダ	社債券	67,000,000	99.44 5,506,650,471	99.54 5,512,298,772	1.680000 2021/06/08	3.60
11	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	43,000,000	119.65 4,252,408,620	125.16 4,448,123,820	2.750000 2048/12/01	2.91
12	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	50,000,000	104.44 4,316,354,925	106.45 4,399,376,850	2.650000 2028/12/15	2.87
13	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	50,000,000	104.12 4,303,006,950	105.95 4,378,549,050	2.900000 2028/06/02	2.86
14	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	50,000,000	101.83 4,208,166,075	101.84 4,208,703,300	2.000000 2023/09/01	2.75
15	Apple Inc	カナダ	社債券	50,000,000	100.86 4,168,328,775	101.54 4,196,305,800	2.513000 2024/08/19	2.74
16	Province of Saskatchewan Canada	カナダ	地方債証券	40,683,000	120.49 4,051,584,067	117.27 3,943,447,676	9.600000 2022/02/04	2.58
17	BRITISH COLUMBIA	カナダ	地方債証券	37,430,000	115.90 3,585,748,653	112.44 3,478,679,520	9.950000 2021/05/15	2.27
18	Royal Bank of Canada	カナダ	社債券	40,000,000	98.79 3,266,195,760	99.12 3,276,940,260	1.583000 2021/09/13	2.14
19	HYDRO QUEBEC	カナダ	社債券	30,835,000	123.76 3,154,115,834	120.65 3,074,959,028	9.625000 2022/07/15	2.01
20	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	35,000,000	100.51 2,907,618,735	100.48 2,906,693,055	2.542000 2023/01/31	1.90
21	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	35,000,000	100.45 2,905,912,012	100.40 2,904,494,565	2.449000 2021/01/29	1.90

22	Royal Bank of Canada	カナダ	社債券	35,000,000	99.46 2,877,360,570	99.64 2,882,393,955	1.968000 2022/03/02	1.88
23	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	32,000,000	102.79 2,718,589,920	104.23 2,756,701,488	2.000000 2028/06/01	1.80
24	Royal Bank of Canada	カナダ	社債券	30,000,000	99.77 2,473,945,920	99.89 2,476,946,115	1.590000 2020/03/23	1.62
25	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	30,000,000	99.60 2,469,705,975	99.87 2,476,499,805	1.816000 2020/07/07	1.62
26	PSP Capital Inc	カナダ	特殊債券	25,000,000	105.91 2,188,489,350	106.05 2,191,258,125	3.290000 2024/04/04	1.43
27	PSP Capital Inc	カナダ	特殊債券	25,000,000	104.84 2,166,277,162	105.88 2,187,890,137	3.000000 2025/11/05	1.43
28	BRITISH COLUMBIA	カナダ	地方債証券	25,000,000	103.72 2,143,197,150	103.17 2,131,750,125	3.250000 2021/12/18	1.39
29	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	25,000,000	100.97 2,086,313,287	102.30 2,113,877,062	2.400000 2026/06/02	1.38
30	Province of Alberta Canada	カナダ	地方債証券	25,000,000	101.02 2,087,408,400	101.81 2,103,752,437	2.350000 2025/06/01	1.37

(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
国債証券	12.44%
地方債証券	40.38%
特殊債券	7.25%
社債券	37.87%
合計	97.94%

(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

(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	カナダ・ドル売/円買 2019年11月	売建	7,000,000	581,904,400	578,340,000	0.38%

(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。

[次へ](#)



## (参考情報) 運用実績

## ● 常陽3分法ファンド

2019年10月31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	9,791円
純資産総額	14億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	5.9%
6カ月間	4.7%
1年間	8.0%
3年間	23.3%
5年間	24.0%
設定来	31.0%



※上記の「基準価額の騰落率」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実質的な運用管理費用(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: 120円 設定来分配金合計額: 2,110円

決算期	第142期	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期	第150期	第151期	第152期	第153期
	18年11月	18年12月	19年1月	19年2月	19年3月	19年4月	19年5月	19年6月	19年7月	19年8月	19年9月	19年10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	業種・用途名	比率
国内株式・先物	81	33.2%	日本円	34.0%	直接利回り(%)	TOPIX先物 O112月	-	2.1%
外国債券	105	32.3%	米ドル	27.7%	最終利回り(%)	信越化学	化学	1.8%
外国リート	68	32.1%	豪ドル	14.9%	修正デュレーション	ダイキン工業	機械	1.5%
			カナダ・ドル	12.1%	残存年数	ファナック	電気機器	1.5%
			ユーロ	4.3%	債券格付別構成 比率	花王	化学	1.5%
			英ポンド	3.1%	AAA	UDR INC	住宅	1.4%
			シンガポール・ドル	2.2%	AA	KLEPIERRE	商業施設	1.3%
			香港ドル	1.2%	A	LINK REIT	商業施設	1.2%
			ニュージーランド・ドル	0.4%	BBB	ESSEX PROPERTY TRUST INC	住宅	1.2%
コール・ローン、その他		4.5%			BB	PROLOGIS INC	産業施設	1.1%
合計	254	-	合計	100.0%	合計	合計		14.5%

※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。

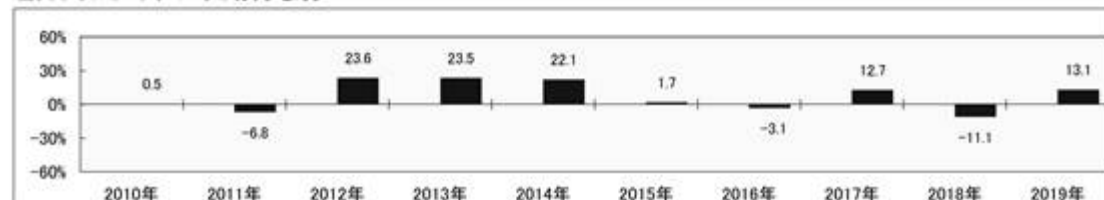
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※業種・用途名については、株式は東証33業種分類、リートはS&P Global Property Indexの分類を原則としています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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。

・2019年は10月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(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（2019年4月6日から2019年10月7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】

### 常陽3分法ファンド

## (1) 【貸借対照表】

	前 期 2019年4月5日現在		当 期 2019年10月7日現在	
	金 額（円）		金 額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		11,270,112		7,695,353
投資信託受益証券		497,027,015		471,516,673
親投資信託受益証券		1,040,035,574		960,734,523
流動資産合計		1,548,332,701		1,439,946,549
資産合計		1,548,332,701		1,439,946,549
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		1,626,652		1,537,427
未払解約金		94,900		466,400
未払受託者報酬		69,811		68,962
未払委託者報酬		1,270,628		1,255,199
その他未払費用		61,604		61,043
流動負債合計		3,123,595		3,389,031
負債合計		3,123,595		3,389,031
純資産の部				
元本等				
元本	1	1,626,652,313		1,537,427,873
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	81,443,207		100,870,355
（分配準備積立金）		95,198,489		92,588,437
元本等合計		1,545,209,106		1,436,557,518
純資産合計		1,545,209,106		1,436,557,518
負債純資産合計		1,548,332,701		1,439,946,549

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 2018年10月6日 至 2019年4月5日	自 2019年4月6日 至 2019年10月7日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	-	9
有価証券売買等損益	906,778	8,011,393
営業収益合計	906,778	8,011,384
営業費用		
支払利息	2,746	2,508
受託者報酬	411,194	400,447
委託者報酬	1 7,484,506	7,288,656
その他費用	61,886	61,098
営業費用合計	7,960,332	7,752,709
営業損失 ( )	7,053,554	15,764,093
経常損失 ( )	7,053,554	15,764,093
当期純損失 ( )	7,053,554	15,764,093
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )	1,134,125	917,073
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	71,345,505	81,443,207
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,355,389	7,076,400
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,355,389	7,076,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	602,523	362,812
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	602,523	362,812
分配金	2 9,931,139	9,459,570
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	81,443,207	100,870,355

## (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 2019年4月6日 至 2019年10月7日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 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。 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)親投資信託受益証券 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。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2019年10月5日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を2019年10月7日としております。このため、当特定期間は185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
	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1. 1 期首元本額	1,711,898,904円	1,626,652,313円
期中追加設定元本額	7,402,250円	4,897,291円
期中一部解約元本額	92,648,841円	94,121,731円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,626,652,313口	1,537,427,873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81,443,207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100,870,355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 2018年10月6日 至 2019年4月5日	自 2019年4月6日 至 2019年10月7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	1,283,944円	1,249,989円

## 2. 2 分配金の計算過程

(自2018年10月6日 至2018年11月5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(1,058,345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(10,375,449円)及び分配準備積立金(93,796,518円)より分配対象額は105,230,312円(1万口当たり625.38円)であり、うち1,682,658円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2018年11月6日 至2018年12月5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(2,234,055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(10,354,981円)及び分配準備積立金(92,556,803円)より分配対象額は105,145,839円(1万口当たり628.74円)であり、うち1,672,320円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2018年12月6日 至2019年1月7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(2,638,104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(10,441,449円)及び分配準備積立金(92,246,886円)より分配対象額は105,326,439円(1万口当たり634.65円)であり、うち1,659,602円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2019年4月6日 至2019年5月7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(936,813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(10,272,879円)及び分配準備積立金(93,628,432円)より分配対象額は104,838,124円(1万口当たり654.96円)であり、うち1,600,680円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2019年5月8日 至2019年6月5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(1,179,171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(10,280,465円)及び分配準備積立金(92,585,591円)より分配対象額は104,045,227円(1万口当たり652.35円)であり、うち1,594,918円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2019年6月6日 至2019年7月5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(3,999,722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(10,261,747円)及び分配準備積立金(91,417,363円)より分配対象額は105,678,832円(1万口当たり667.63円)であり、うち1,582,904円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

<p>(自2019年1月8日 至2019年2月5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(2,073,457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(10,469,589円)及び分配準備積立金(92,707,150円)より分配対象額は105,250,196円(1万口当たり637.20円)であり、うち1,651,750円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年7月6日 至2019年8月5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(1,104,833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(10,265,374円)及び分配準備積立金(93,443,108円)より分配対象額は104,813,315円(1万口当たり664.63円)であり、うち1,577,009円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2019年2月6日 至2019年3月5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(3,000,731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(10,422,357円)及び分配準備積立金(92,323,831円)より分配対象額は105,746,919円(1万口当たり645.52円)であり、うち1,638,157円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年8月6日 至2019年9月5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(2,278,833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(10,242,343円)及び分配準備積立金(92,314,935円)より分配対象額は104,836,111円(1万口当たり669.18円)であり、うち1,566,632円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2019年3月6日 至2019年4月5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(3,835,611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(10,388,392円)及び分配準備積立金(92,989,530円)より分配対象額は107,213,533円(1万口当たり659.11円)であり、うち1,626,652円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年9月6日 至2019年10月7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(2,879,269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(10,098,113円)及び分配準備積立金(91,246,595円)より分配対象額は104,223,977円(1万口当たり677.91円)であり、うち1,537,427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 2019年4月6日 至 2019年10月7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。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び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。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。
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
	2019年10月7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	当 期
	2019年4月5日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2019年10月7日現在 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	1,474,859	28,780,437
親投資信託受益証券	23,187,337	5,561,300
合計	24,662,196	34,341,737

## （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	当 期
2019年4月5日現在	2019年10月7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）



<b>当 期</b> 自 2019年4月6日 至 2019年10月7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 2019年4月5日現在	当 期 2019年10月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9499円 (9,499円)	0.9344円 (9,344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	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	(F0Fs専用)ダイワいばらきファンド (適格機関投資家専用)	430,844,914	471,516,673	
投資信託受益証券 合計			471,516,673	
親投資信託受益証券	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	100,777,639	160,357,379	
	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	60,044,035	158,149,983	
	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	92,437,495	159,722,747	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	183,769,201	482,504,414	
親投資信託受益証券 合計			960,734,523	
合計			1,432,251,196	

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。

## 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、「(F0Fs専用)ダイワいばらきファンド(適格機関投資家専用)」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「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。

また、当ファンドは、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」受益証券及び「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」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。

なお、同ファンドの状況及び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は次のとおりであります。

[次へ](#)

## 「ダイワ・グローバルREIT・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

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	4,498,427,482	3,546,625,445
コール・ローン	356,300,948	335,347,151
投資証券	91,829,199,183	86,932,201,053
派生商品評価勘定	24,828	220,988
未収入金	104,158,057	908,273,622
未収配当金	233,538,703	225,852,689
流動資産合計	97,021,649,201	91,948,520,948
資産合計	97,021,649,201	91,948,520,948
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,159,331	61,858
未払金	343,473,179	185,705,475
未払株式払込金	-	162,712,600
未払解約金	304,359,000	128,929,000
その他未払費用	624	61
流動負債合計	648,992,134	477,408,994
負債合計	648,992,134	477,408,994
純資産の部		
元本等		
元本	1 37,704,296,584	34,837,631,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,668,360,483	56,633,480,395
元本等合計	96,372,657,067	91,471,111,954
純資産合計	96,372,657,067	91,471,111,954
負債純資産合計	97,021,649,201	91,948,520,948

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2019年4月6日 至 2019年10月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券  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。 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 原則として、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>
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 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		2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1.	1 期首	2018年10月6日	2019年4月6日
	期首元本額	42,594,088,903円	37,704,296,584円
	期中追加設定元本額	85,984,949円	107,328,131円
	期中一部解約元本額	4,975,777,268円	2,973,993,156円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)	33,850,824,707円	31,116,967,655円
	ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	31,623,358円	28,704,641円
	安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	17,123,394円	15,568,509円
	インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	15,260,201円	14,081,889円
	成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	78,564,300円	68,310,101円
	6資産バランスファンド(分配型)	138,093,000円	128,693,057円
	6資産バランスファンド(成長型)	324,266,286円	299,053,605円
	りそな ワールド・リート・ファンド	1,520,870,117円	1,430,766,183円
	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	43,899,511円	40,366,215円
	『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	4,230,068円	3,601,351円
	常陽3分法ファンド	206,396,390円	183,769,201円
	ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	47,241,427円	42,569,009円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	233,056,780円	256,849,387円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	309,198,959円	330,481,144円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	394,136,613円	432,819,443円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	31,820,441円	30,116,510円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	402,162,687円	362,272,578円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)	24,213,029円	23,313,757円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	31,315,316円	29,327,324円
計	37,704,296,584円	34,837,631,559円
2. 期末日における受益権の総数	37,704,296,584口	34,837,631,559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 2019年4月6日 至 2019年10月7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。 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	2019年10月7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	2019年4月5日現在	2019年10月7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）
投資証券	1,500,815,623	1,849,174,792
合計	1,500,815,623	1,849,174,792

（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（2019年3月16日から2019年4月5日まで、及び2019年9月18日から2019年10月7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	2019年4月5日 現在				2019年10月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	539,635,420	-	540,726,592	1,091,172	604,990,154	-	604,865,923	124,231
アメリカ・ドル	537,397,093	-	538,488,571	1,091,478	380,255,267	-	380,240,637	14,630
イギリス・ポンド	2,238,327	-	2,238,021	306	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	185,858,030	-	185,833,998	24,032
香港・ドル	-	-	-	-	38,876,857	-	38,791,288	85,569
買 建	93,631,420	-	93,588,089	43,331	231,456,154	-	231,491,053	34,899
アメリカ・ドル	2,238,327	-	2,234,590	3,737	224,734,887	-	224,768,746	33,859
ユーロ	91,393,093	-	91,353,499	39,594	6,721,267	-	6,722,307	1,040
合計	633,266,840	-	634,314,681	1,134,503	836,446,308	-	836,356,976	159,130

（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）

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5560円 (25,560円)	2.6256円 (26,256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
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	300,462	8,085,432.420	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	107,314	15,882,472.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	61,542	7,921,070.820	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	224,920	11,992,734.400	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,425	2,229,766.500	
		EQUINIX INC	43,002	25,012,113.300	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	312,114	9,035,700.300	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	127,869	2,125,182.780	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	291,589	9,870,287.650	
		CYRUSONE INC	188,705	14,596,331.750	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	356,213	8,517,052.830	
		INVITATION HOMES INC	579,045	17,423,464.050	
		VICI PROPERTIES INC	673,625	15,459,693.750	
		VEREIT INC	1,075,874	10,812,533.700	
		SUN COMMUNITIES INC	82,789	12,604,625.250	
		PROLOGIS INC	325,005	28,012,180.950	
		COUSINS PROPERTIES INC	167,208	6,268,627.920	
		SITE CENTERS CORP	442,920	6,550,786.800	
		DUKE REALTY CORP	364,754	12,496,472.040	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	94,697	31,287,888.800	
		WELLTOWER INC	377,530	34,717,658.800	
		KILROY REALTY CORP	135,123	10,523,379.240	
		MACERICH CO/THE	247,713	7,186,154.130	
		REALTY INCOME CORP	273,424	21,439,175.840	
		PUBLIC STORAGE	61,391	15,152,526.620	
		REGENCY CENTERS CORP	186,255	12,855,320.100	
		UDR INC	686,757	33,671,695.710	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	151,846	6,439,788.860	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,044	3,001,941.880	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	124,119	14,577,776.550	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	311,256	6,060,154.320	
			アメリカ・ドル 小計		
イギリス・ポンド				イギリス・ポンド	
		ASSURA PLC	7,714,791	5,608,653.050	
		SEGRO PLC	1,657,433	13,375,484.310	
		UNITE GROUP PLC	726,018	7,862,774.940	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	219,295	1,620,590.050	
		DERWENT LONDON PLC	181,865	5,986,995.800	
WORKSPACE GROUP PLC	351,620	3,298,195.600			

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	668,333	4,441,072.780
	BIG YELLOW GROUP PLC	162,724	1,736,265.080
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,662,530	10,136,340.220
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 54,066,371.830 (7,117,297,187)
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	11,895,590	21,531,017.900
	MIRVAC GROUP	10,322,741	31,484,360.050
	GOODMAN GROUP	2,766,374	39,337,838.280
	CHARTER HALL GROUP	2,081,841	24,274,266.060
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	5,400,713	21,818,880.520
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 138,446,362.810 (9,990,289,541)
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	397,407	17,859,470.580
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	403,368	21,693,131.040
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 39,552,601.620 (3,170,932,072)
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	10,142,441	19,372,062.310
	KEPPEL DC REIT	3,103,600	5,412,678.400
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,624,200	3,678,813.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,839,000	5,664,120.000
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,464,377	20,298,143.780
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	7,053,835	17,140,819.050
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 71,566,636.540 (5,534,963,670)
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	7,659,508	16,965,810.220
ニュージーランド・ドル	小計		ニュージーランド・ドル 16,965,810.220 (1,144,343,899)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	366,919	5,911,065.090
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	37,819	999,177.980
	NSI NV	57,408	2,284,838.400
	ARGAN	15,880	1,048,080.000
	GECINA SA	77,999	11,208,456.300
	KLEPIERRE	827,069	25,283,499.330
	COVIVIO	187,216	18,028,900.800
	AEDIFICA	65,025	6,801,615.000
	BEFIMMO	65,574	3,718,045.800
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	26,275	4,393,180.000
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	529,994	5,978,332.320
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	472,059	6,065,958.150
ユーロ	小計		ユーロ 91,721,149.170 (10,753,387,529)
香港・ドル	LINK REIT	3,526,305	308,375,372.250
香港・ドル	小計		香港・ドル 308,375,372.250 (4,196,988,816)
投資証券	合計		86,932,201,053

		[86,932,201,053]	
合計		86,932,201,053	
		[86,932,201,053]	

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 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 31銘柄	100%	51.8%
イギリス・ポンド	投資証券 9銘柄	100%	8.2%
オーストラリア・ドル	投資証券 5銘柄	100%	11.5%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.6%
シンガポール・ドル	投資証券 6銘柄	100%	6.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.3%
ユーロ	投資証券 12銘柄	100%	12.4%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	4.8%

## 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。

[次へ](#)



「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」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

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	80,662,494	379,588,709
コール・ローン	56,557,381	246,543,231
国債証券	15,621,875,170	16,929,488,093
特殊債券	551,732,036	545,083,821
社債券	16,832,158,743	12,169,510,262
未収入金	616,010,557	-
未収利息	201,387,658	186,549,017
前払費用	1,620,009	5,578,470
差入委託証拠金	147,091,230	141,531,560
流動資産合計	34,109,095,278	30,603,873,163
資産合計	34,109,095,278	30,603,873,163
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	696,750	-
未払金	287,987,182	-
未払解約金	187,918,831	58,928,559
その他未払費用	57	18
流動負債合計	476,602,820	58,928,577
負債合計	476,602,820	58,928,577
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,206,960,143	19,196,461,216
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,425,532,315	11,348,483,370
元本等合計	33,632,492,458	30,544,944,586
純資産合計	33,632,492,458	30,544,944,586
負債純資産合計	34,109,095,278	30,603,873,163

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年4月6日 至 2019年10月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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>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	<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		2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1.	1 期首	2018年10月6日	2019年4月6日
	期首元本額	23,487,081,907円	21,206,960,143円
	期中追加設定元本額	2,219,941円	99,094,623円
	期中一部解約元本額	2,282,341,705円	2,109,593,550円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ世界債券ファンドM （FOFs用）（適格機関投資家専用）	142,441,546円	133,392,625円
	常陽3分法ファンド	107,107,221円	100,777,639円
	ダイワ世界債券ファンドV A （適格機関投資家専用）	21,571,767円	20,048,498円
	ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	3,208,096,219円	2,893,416,492円
	ダイワ・グローバル債券ファンド（年2回決算型）	80,286,180円	70,833,063円
	ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	4,949,147円	4,027,040円
	ダイワ・グローバル債券ファンド（毎月分配型）	17,642,508,063円	15,973,965,859円
	計	21,206,960,143円	19,196,461,216円
2.	期末日における受益権の総数	21,206,960,143口	19,196,461,216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 2019年4月6日 至 2019年10月7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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年10月7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	2019年4月5日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2019年10月7日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
	国債証券	218,484,724
特殊債券	4,433,267	389,601
社債券	54,480,515	8,519,066
合計	277,398,506	59,596,591

(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（2019年3月6日から2019年4月5日まで、及び2019年9月6日から2019年10月7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	2019年4月5日 現在				2019年10月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	278,728,250	-	279,425,000	696,750	-	-	-	-
アメリカ・ドル	278,728,250	-	279,425,000	696,750	-	-	-	-

合計	278,728,250	-	279,425,000	696,750	-	-	-	-
----	-------------	---	-------------	---------	---	---	---	---

## (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)

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5859円 (15,859円)	1.5912円 (15,912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	1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	20,000,000.000	20,170,200.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	8,500,000.000	12,246,630.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	30,000,000.000	30,281,100.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	17,000,000.000	18,719,890.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	18,000,000.000	18,091,260.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	15,000,000.000	15,863,550.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	7,500,000.000	8,356,575.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	34,500,000.000	34,875,705.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 158,604,910.000 (16,929,488,093)	
国債証券	合計			16,929,488,093 [16,929,488,093]	
特殊債券	アメリカ・ドル	2.375% Temasek Financial I Ltd 20230123	5,000,000.000	5,106,650.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 5,106,650.000	

				(545,083,821)	
特殊債券	合計			545,083,821	[545,083,821]
社債券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.125% Toronto-Dominion Bank/The 20210407	10,000,000.000	10,063,000.000	
		4.125% HSBC Bank PLC 20200812	7,000,000.000	7,125,790.000	
		2.5% United Overseas Bank Ltd 20200318	3,000,000.000	3,002,760.000	
		4.125% Total Capital SA 20210128	5,000,000.000	5,154,200.000	
		1.55% Microsoft Corp 20210808	5,000,000.000	5,001,450.000	
		2.7% Total Capital International SA 20230125	5,000,000.000	5,138,700.000	
		2.15% Wells Fargo Bank NA 20191206	5,000,000.000	5,001,050.000	
		2.355% Chevron Corp 20221205	5,000,000.000	5,094,700.000	
		2.8% National Australia Bank Ltd/New York 20220110	6,000,000.000	6,138,240.000	
		2.4% COMMONWEALTH BK AUSTR NY 20201102	4,000,000.000	4,024,080.000	
		2.1% Royal Bank of Canada 20201014	5,000,000.000	5,015,600.000	
		4.75% RABOBANK NEDERLAND 20200115	3,000,000.000	3,022,230.000	
		4.5% RABOBANK NEDERLAND 20210111	10,500,000.000	10,853,850.000	
		3.2% Sumitomo Mitsui Banking Corp 20220718	5,000,000.000	5,163,800.000	
		3.95% Sumitomo Mitsui Banking Corp 20230719	9,000,000.000	9,629,460.000	
		2.85% Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The 20210908	10,000,000.000	10,147,200.000	
		5.1% AUST & NZ BANK 20200113	9,135,000.000	9,207,531.900	
		5% Commonwealth Bank of Australia 20191015	5,224,000.000	5,227,134.400	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル	
				114,010,776.300	(12,169,510,262)
社債券	合計			12,169,510,262	[12,169,510,262]
合計				29,644,082,176	[29,644,082,176]

- (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	8銘柄	100%
	特殊債券	1銘柄	
	社債券	18銘柄	
			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。

[次へ](#)

「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」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

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,722,918	68,080,587
コール・ローン	15,754,164	3,122,114
国債証券	1,206,905,554	1,178,397,191
地方債証券	604,955,477	574,765,946
特殊債券	8,185,708,905	6,931,032,294
社債券	1,869,912,761	1,755,285,476
未収入金	123,372,504	-
未収利息	105,284,762	86,490,640
前払費用	-	140,712
差入委託証拠金	41,099,069	37,327,377
流動資産合計	12,154,716,114	10,634,642,337
資産合計	12,154,716,114	10,634,642,337
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	228,450	9,220
未払解約金	35,306,422	6,226,012
その他未払費用	18	1
流動負債合計	35,534,890	6,235,233
負債合計	35,534,890	6,235,233
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,381,840,373
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,737,340,851
元本等合計		12,119,181,224
純資産合計		12,119,181,224
負債純資産合計		12,154,716,114

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年4月6日 至 2019年10月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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>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	<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		2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1.	1 期首	2018年10月6日	2019年4月6日
	期首元本額	5,411,350,188円	4,381,840,373円
	期中追加設定元本額	5,858,489円	23,264,026円
	期中一部解約元本額	1,035,368,304円	369,852,598円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ世界債券ファンドM	81,901,665円	79,784,007円
	（FOFs用）（適格機関投資家専用）		
	常陽3分法ファンド	61,852,628円	60,044,035円
	ダイワ世界債券ファンドV A	12,413,021円	12,084,504円
	（適格機関投資家専用）		
	ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	1,842,071,280円	1,734,717,327円
	ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	2,867,454円	2,419,820円
	ダイワ高格付豪ドル債オープン（毎月分配型）	2,380,734,325円	2,146,202,108円
	計	4,381,840,373円	4,035,251,801円
2.	期末日における受益権の総数	4,381,840,373口	4,035,251,801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 2019年4月6日 至 2019年10月7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	2019年10月7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	2019年4月5日現在		2019年10月7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	33,889,096		57,948,160	
地方債証券	24,742,437		26,287,888	
特殊債券	200,597,667		174,994,714	
社債券	61,267,596		65,899,196	
合計	320,496,796		325,129,958	

(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（2018年10月16日から2019年4月5日まで、及び2019年4月16日から2019年10月7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	2019年4月5日 現在				2019年10月7日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
	うち 1年超				うち 1年超			
市場取引以外の取引								



為替予約取引								
売 建	39,536,550	-	39,765,000	228,450	14,420,780	-	14,430,000	9,220
オーストラリア・ドル	39,536,550	-	39,765,000	228,450	14,420,780	-	14,430,000	9,220
合計	39,536,550	-	39,765,000	228,450	14,420,780	-	14,430,000	9,220

## (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)

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7658円 (27,658円)	2.6339円 (26,339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	オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	500,000.000	540,780.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	4,500,000.000	5,473,710.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	8,000,000.000	9,115,680.000	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	900,000.000	1,200,168.000	
	オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 16,330,338.000 (1,178,397,191)	
国債証券	合計			1,178,397,191 [1,178,397,191]	
地方債証券	オーストラリア・ドル	4% AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 20240522	5,000,000.000	5,692,300.000	
		3% AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 20280418	2,000,000.000	2,272,860.000	

	オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 7,965,160.000 (574,765,946)	
地方債証券	合計			574,765,946 [574,765,946]	
特殊債券	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		5.5% LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK 20220329	5,000,000.000	5,548,500.000	
		2.7% LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK 20220905	3,000,000.000	3,145,140.000	
		5% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20240319	8,000,000.000	9,363,040.000	
		4.75% Airservices Australia 20201119	4,400,000.000	4,578,948.000	
		2.75% Airservices Australia 20230515	2,860,000.000	3,001,112.400	
		3% WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP. 20261021	3,000,000.000	3,376,620.000	
		3% South Australia GOV.FIN.AUTH. 20280524	5,000,000.000	5,694,650.000	
		5.75% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20240722	7,000,000.000	8,577,590.000	
		3.25% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20260721	10,000,000.000	11,380,500.000	
		2.8% INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT 20210113	3,000,000.000	3,069,690.000	
		4.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20240807	9,500,000.000	11,132,860.000	
		5% NORDIC INVESTMENT BK. 20220419	5,000,000.000	5,496,500.000	
		6% COUNCIL OF EUROPE 20201008	1,065,000.000	1,117,440.600	
		5% ASIAN DEVELOPMENT BANK 20220309	3,000,000.000	3,288,180.000	
		2.7% INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 20210818	7,000,000.000	7,223,720.000	
		2.75% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20200203	10,000,000.000	10,056,400.000	
	オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 96,050,891.000 (6,931,032,294)	
特殊債券	合計			6,931,032,294 [6,931,032,294]	
社債券	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		2.05% Toronto-Dominion Bank/The 20240710	1,800,000.000	1,832,778.000	
		3.75% University of Sydney 20250828	6,000,000.000	6,804,660.000	
		3.98% Australian National University 20251118	4,040,000.000	4,632,829.600	
		3.2% Bank of Nova Scotia/Australia 20230907	600,000.000	639,558.000	
		4.25% University Of Melbourne 20210630	2,400,000.000	2,531,376.000	
		3.5% Macquarie University 20280907	1,000,000.000	1,155,840.000	
		3.25% Commonwealth Bank of Australia 20220117	5,000,000.000	5,237,050.000	
		3.2% Westpac Banking Corp 20230306	1,400,000.000	1,490,818.000	
	オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 24,324,909.600 (1,755,285,476)	

社債券 合計		1,755,285,476 [1,755,285,476]	
合計		10,439,480,907 [10,439,480,907]	

- (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
オーストラリア・ドル	国債証券	4銘柄	100%
	地方債証券	2銘柄	
	特殊債証券	16銘柄	
	社債券	8銘柄	
			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  
 「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。

[次へ](#)

## 「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」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

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,219,075,860	1,398,912,925
コール・ローン	6,313,131	693,548,682
国債証券	24,687,116,691	20,061,890,450
地方債証券	67,774,038,724	61,791,118,783
特殊債券	12,175,947,613	11,556,834,198
社債券	67,644,153,041	56,510,513,813
派生商品評価勘定	136,800	16,800
未収入金	657,320,864	-
未収利息	1,925,034,962	1,726,211,439
前払費用	18,558,841	3,563,721
差入委託証拠金	86,124,525	82,909,374
流動資産合計	176,193,821,052	153,825,520,185
資産合計	176,193,821,052	153,825,520,185
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,400	-
未払解約金	499,969,646	304,971,794
その他未払費用	624	73
流動負債合計	499,996,670	304,971,867
負債合計	499,996,670	304,971,867
純資産の部		
元本等		
元本	1 99,944,609,363	88,848,685,582
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	75,749,215,019	64,671,862,736
元本等合計	175,693,824,382	153,520,548,318
純資産合計	175,693,824,382	153,520,548,318
負債純資産合計	176,193,821,052	153,825,520,185

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2019年4月6日 至 2019年10月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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>

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	<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		2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1.	1 期首	2018年10月6日	2019年4月6日
	期首元本額	114,940,525,207円	99,944,609,363円
	期中追加設定元本額	67,841,201円	69,347,715円
	期中一部解約元本額	15,063,757,045円	11,165,271,496円
	期末元本額の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ世界債券ファンドM	128,985,298円	121,562,161円
	(FOFs用)(適格機関投資家専用)		
	常陽3分法ファンド	97,589,774円	92,437,495円
	ダイワ高格付カナダドル債	1,771,735,757円	1,643,875,980円
	オープン(年1回決算型)		
	ダイワ高格付カナダドル債	78,279,699円	70,225,319円
	オープン・為替アクティブ		
	ヘッジ(毎月分配型)		
	ダイワ世界債券ファンドV A	19,581,835円	18,340,588円
	(適格機関投資家専用)		
	ダイワ世界債券ファンド(毎月分配型)	2,896,111,033円	2,645,815,756円
	ダイワ・グローバル債券ファ	48,210,717円	43,201,326円
	ンド(年2回決算型)		
	ダイワ世界債券ファンド(年2	4,469,890円	3,683,194円
	回決算型)		
	ダイワ高格付カナダドル債	84,315,965,714円	74,475,791,431円
	オープン(毎月分配型)		
	ダイワ・グローバル債券ファ	10,583,679,646円	9,733,752,332円
	ンド(毎月分配型)		
	計	99,944,609,363円	88,848,685,582円
2.	期末日における受益権の総数	99,944,609,363口	88,848,685,582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 2019年4月6日 至 2019年10月7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	2019年10月7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	2019年4月5日現在	2019年10月7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	575,672,867	641,803,613
地方債証券	1,762,792,496	340,805,090
特殊債券	581,484,610	286,178,841
社債券	928,749,140	170,235,911
合計	3,848,699,113	1,098,551,633

（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（2018年11月13日から2019年4月5日まで、及び2019年5月11日から2019年10月7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	2019年4月5日 現在				2019年10月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,672,590,400	-	1,672,480,000	110,400	641,216,800	-	641,200,000	16,800
カナダ・ドル	1,672,590,400	-	1,672,480,000	110,400	641,216,800	-	641,200,000	16,800
合計	1,672,590,400	-	1,672,480,000	110,400	641,216,800	-	641,200,000	16,800

## (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)

	2019年4月5日現在	2019年10月7日現在
1口当たり純資産額	1.7579円	1.7279円
(1万口当たり純資産額)	(17,579円)	(17,279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	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315	13,545,000.000	15,270,226.650	
		9.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	8,000,000.000	9,074,640.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	12,000,000.000	12,672,720.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	43,000,000.000	56,613,800.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	70,000,000.000	71,225,700.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	32,000,000.000	34,033,280.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	50,000,000.000	51,351,500.000	

	カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 250,241,866.650 (20,061,890,450)
国債証券 合計				20,061,890,450 [20,061,890,450]
地方債証券	カナダ・ドル	9.6% Province of Nova Scotia Canada 20220130	カナダ・ドル 3,430,000.000	カナダ・ドル 4,045,513.500
		9.375% Province of Quebec Canada 20230116	15,000,000.000	18,665,550.000
		4.25% Province of Quebec Canada 20211201	71,000,000.000	74,987,360.000
		2.5% Province of Quebec Canada 20260901	92,000,000.000	96,236,600.000
		9.5% ONTARIO PROVINCE 20250602	7,822,000.000	11,085,729.500
		3.15% ONTARIO PROVINCE 20220602	20,000,000.000	20,803,200.000
		3.5% ONTARIO PROVINCE 20240602	83,000,000.000	89,717,190.000
		4% ONTARIO PROVINCE 20210602	5,000,000.000	5,196,850.000
		2.4% ONTARIO PROVINCE 20260602	25,000,000.000	25,937,000.000
		2.9% ONTARIO PROVINCE 20280602	50,000,000.000	53,940,500.000
		9.6% Province of Saskatchewan Canada 20220204	40,683,000.000	48,089,746.980
		8.75% PROVINCE OF SASKATCHEWAN 20250530	2,000,000.000	2,749,180.000
		9.95% BRITISH COLUMBIA 20210515	40,430,000.000	45,763,121.300
		9% BRITISH COLUMBIA 20240823	11,860,000.000	15,901,532.200
		10.6% BRITISH COLUMBIA 20200905	10,587,000.000	11,436,289.140
		9.5% BRITISH COLUMBIA 20220609	89,400,000.000	107,672,466.000
		3.25% BRITISH COLUMBIA 20211218	25,000,000.000	25,905,000.000
		2.2% Province of Alberta Canada 20260601	78,000,000.000	79,727,700.000
		3.3% Province of Alberta Canada 20461201	6,000,000.000	7,125,360.000
		2.35% Province of Alberta Canada 20250601	25,000,000.000	25,765,250.000
	カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 770,751,138.620 (61,791,118,783)
地方債証券 合計				61,791,118,783 [61,791,118,783]
特殊債券	カナダ・ドル	3.29% PSP Capital Inc 20240404	カナダ・ドル 25,000,000.000	カナダ・ドル 26,767,000.000
		1.73% PSP Capital Inc 20220621	20,000,000.000	20,081,000.000
		3% PSP Capital Inc 20251105	25,000,000.000	26,813,500.000
		3% CPPIB Capital Inc 20280615	15,000,000.000	16,341,600.000
		2.65% CANADA HOUSING TRUST 20281215	50,000,000.000	54,151,000.000
			カナダ・ドル	小計
特殊債券 合計				11,556,834,198 [11,556,834,198]
社債券	カナダ・ドル	2.621% Toronto-Dominion Bank/The 20211222	カナダ・ドル 70,000,000.000	カナダ・ドル 70,992,600.000
		1.68% Toronto-Dominion Bank/The 20210608	67,000,000.000	66,853,940.000
		2.045% Toronto-Dominion Bank/The 20210308	5,000,000.000	5,007,850.000



	1.909% Toronto-Dominion Bank/The 20230718	25,000,000.000	24,948,250.000	
	2.542% HSBC Bank Canada 20230131	35,000,000.000	35,409,150.000	
	2.17% HSBC Bank Canada 20220629	10,000,000.000	10,007,500.000	
	2.908% HSBC Bank Canada 20210929	20,000,000.000	20,315,000.000	
	2.449% HSBC Bank Canada 20210129	35,000,000.000	35,184,450.000	
	1.816% HSBC Bank Canada 20200707	30,000,000.000	29,962,800.000	
	2.513% Apple Inc 20240819	50,000,000.000	51,215,000.000	
	10.5% HYDRO QUEBEC 20211015	14,660,000.000	17,230,777.600	
	9.625% HYDRO QUEBEC 20220715	30,835,000.000	37,505,843.900	
	10.125% Ontario Electricity Financial Corp 20211015	88,681,000.000	103,598,917.820	
	8.9% Ontario Electricity Financial Corp 20220818	60,274,000.000	72,354,717.820	
	9% Ontario Electricity Financial Corp 20250526	5,400,000.000	7,457,238.000	
	1.59% Royal Bank of Canada 20200323	30,000,000.000	29,967,600.000	
	1.968% Royal Bank of Canada 20220302	35,000,000.000	34,987,750.000	
	2.333% Royal Bank of Canada 20231205	12,000,000.000	12,146,160.000	
	1.583% Royal Bank of Canada 20210913	40,000,000.000	39,738,000.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 704,883,545.140 (56,510,513,813)	
社債券	合計		56,510,513,813 [56,510,513,813]	
合計			149,920,357,244 [149,920,357,244]	

- (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
カナダ・ドル	国債証券	7銘柄	100%
	地方債証券	20銘柄	
	特殊債券	5銘柄	
	社債券	19銘柄	
			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  
「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。

## 2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

## 【純資産額計算書】

2019年10月31日

資産総額	1,486,684,416円
負債総額	2,984,340円
純資産総額（ - ）	1,483,700,076円
発行済数量	1,515,333,744口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9791円

(参考) (F0Fs専用) ダイワいばらきファンド (適格機関投資家専用)

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	494,935,656円
負債総額	759,509円
純資産総額（ - ）	494,176,147円
発行済数量	421,356,990口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1728円

参考情報 茨城マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	4,618,255,123円
負債総額	21,882,000円
純資産総額（ - ）	4,596,373,123円
発行済数量	1,775,491,759口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5888円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	95,935,242,850円
負債総額	939,766,397円
純資産総額（ - ）	94,995,476,453円

発行済数量	34,462,668,568口
1単位当たり純資産額( / )	2.7565円

## (参考) ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	30,740,007,382円
負債総額	879,767円
純資産総額( - )	30,739,127,615円
発行済数量	19,117,938,226口
1単位当たり純資産額( / )	1.6079円

## (参考) ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	10,943,123,691円
負債総額	21,733,080円
純資産総額( - )	10,921,390,611円
発行済数量	4,004,949,247口
1単位当たり純資産額( / )	2.7270円

## (参考) ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年10月31日

資産総額	153,738,801,144円
負債総額	679,023,138円
純資産総額( - )	153,059,778,006円
発行済数量	86,566,707,670口
1単位当たり純資産額( / )	1.7681円

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「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 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2019年10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. 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。

##### ハ. 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。

## 二．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

### ・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。

2019年10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	62	117,037
追加型株式投資信託	716	16,432,363
株式投資信託 合計	778	16,549,401
単位型公社債投資信託	27	88,996
追加型公社債投資信託	14	1,431,605
公社債投資信託 合計	41	1,520,601
総合計	819	18,070,002

## 3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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。
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、当事業年度（2018年4月1日から2019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。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	1
建物	213	206
器具備品	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183

その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052

利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178



租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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
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	12,712	13,086	39,756
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	13,850	14,225	40,895

	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
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	264	264	40,021
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	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
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
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

## 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。

(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)を当事業年度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前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

#### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

#### (2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(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)等を当事業年度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。

(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「受取配当金」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「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

## 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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

## 3 保証債務

前事業年度（2018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。

当事業年度（2019年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万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 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018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	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
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

## (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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24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(2018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 その他有価証券		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。



当事業年度(2019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		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(\*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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018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 <sub>    </sub> 其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

当事業年度(2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 <sub>    </sub> 其他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018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、記載していません。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社株式(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、記載していません。

## 2. 其他有価証券

前事業年度(2018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「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2) その他			
証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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。

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2) その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

### 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 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

(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 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

## 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171百万円、当事業年度174百万円であります。

## (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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

## 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（2018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（2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

## (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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)(注1)
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)	19,975	未払手数料	3,400
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)	1,052	未払費用	173
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)	1,063	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せん。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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おりません。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。



(注3) 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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870
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。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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。）。

通常の実行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

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

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】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

### 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（2019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 株式会社常陽銀行

資本金の額 85,113百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

### 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いません。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いません。

### 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（2019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】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

次の事項を記載することがあります。

- ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

<略>

## 独立監査人の監査報告書

2019年11月8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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	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、「ファンドの経理状況」に掲げられている常陽3分法ファンドの2019年4月6日から2019年10月7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、常陽3分法ファンドの2019年10月7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。

---

(注)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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月24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2019年3月31日現在の財政状態及び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。