

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成28年2月2日提出
【計算期間】	第17特定期間 (自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日)
【ファンド名】	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） (愛称：D・51)
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【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】	山村 政
【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】	03-5555-3111
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、内外の公社債、不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年6回（隔月）」...目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### < ファンドの特色 >

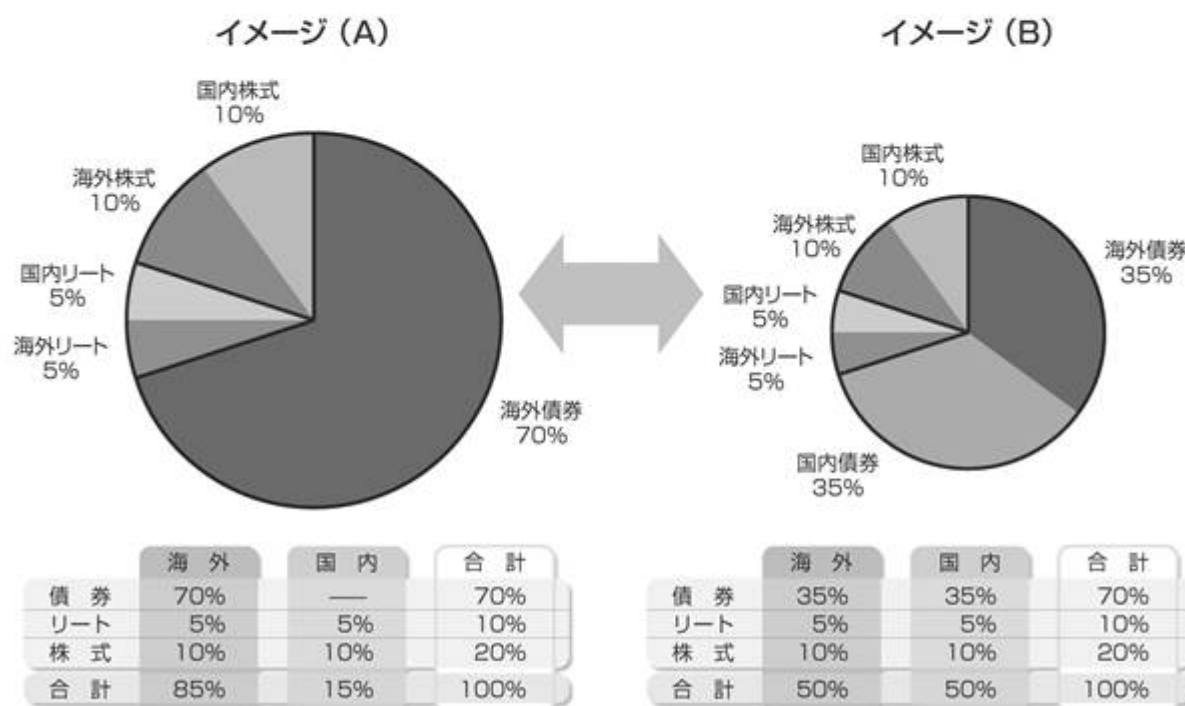
## 1

## 内外の公社債、リートおよび株式に投資します。

- 各資産の組入比率については、下記イメージ（A）の組入比率を目処とします。

ただし、毎年6月末において、「ダイワ日本国債マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りが「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りを上回った場合は、下記イメージ（B）の組入比率を目処とします。

- 平成27年11月末現在、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りは、「ダイワ日本国債マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りを上回っています。



（注1）上記は、イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

（注2）市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



(注) 組入れについては、前記1.をご参照下さい。

## 2

海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

## ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上<sup>\*1</sup>、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上<sup>\*2</sup>とすることを基本とします。

## 債券の格付けについて

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

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

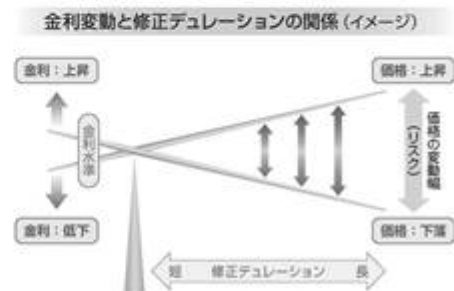
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

## 修正デュレーションについて

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



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

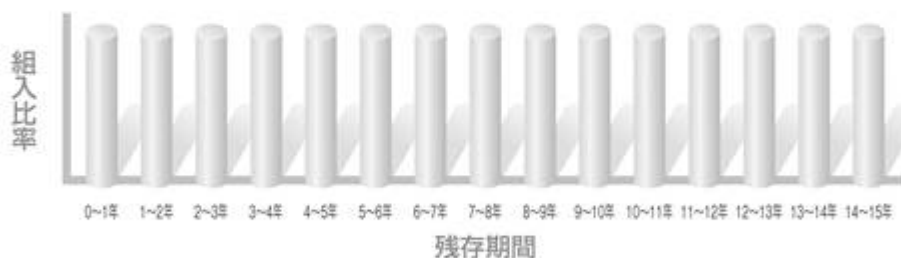
## 3

わが国の公社債への投資にあたっては、国債に投資します。

※平成27年11月末現在、わが国の国債には投資していません。

- 残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

## 残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

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

## 4

内外のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

- 海外のリートへの投資にあたっては、組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- 海外のリートの運用は、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

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

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



## 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 〈コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

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

- わが国のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 5

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

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成 (イメージ)



好配当株とは (イメージ)



- ◆ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ◆北米の株式への投資にあたっては、株式のほかハイブリッド優先証券<sup>®</sup>を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

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

- ◆欧州の株式の運用にあたっては、バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

〈コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

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

〈バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて〉

- ・欧州を基盤とした運用グループである「バイオニア・インベストメンツ・グループ」（欧州大手銀行、ウニクレディト・イタリアーノS.p.A.の100%子会社）の運用拠点の一つ。特に欧州株式、欧州債券の運用に強みを持つ。
- ・運用哲学：リサーチ・チームによるファンダメンタルズ分析、クウォンツ・チームによる定量分析・リスク管理、ポートフォリオ・マネージャーによるアクティブな運用を総合的に生かすことにより、さまざまな投資機会を捉え、グローバルな観点から投資を行ない超過収益の獲得をめざす。
- ・所在地：アイルランド ダブリン



## 6

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

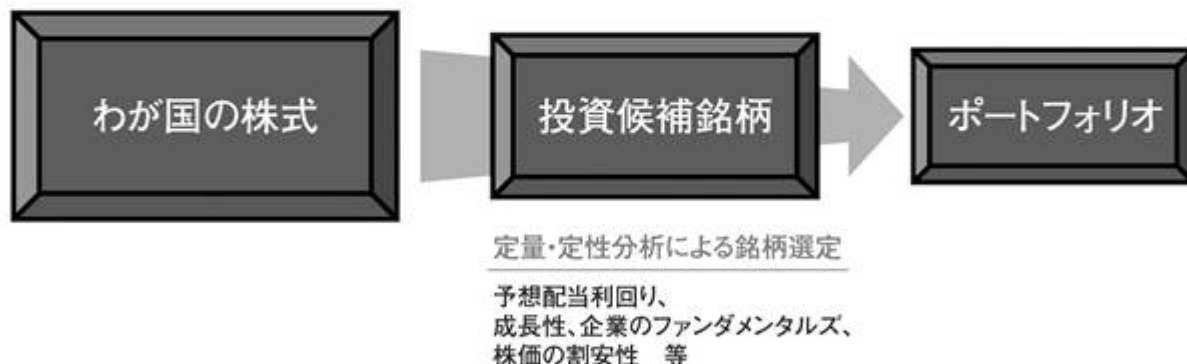
## 投資対象のイメージ



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

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

## 銘柄選定プロセス



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

• 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～6.の運用が行なわれないことがあります。

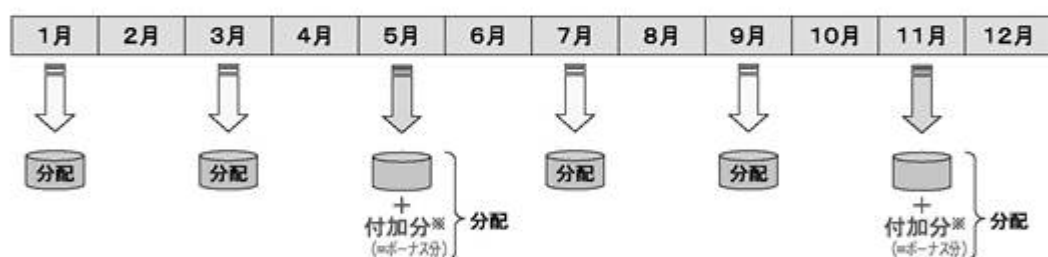
## 7

毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11月）の各8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

## 〈分配方針〉

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。5月と11月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

## 収益分配のイメージ



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

## 【収益分配金に関する留意事項】

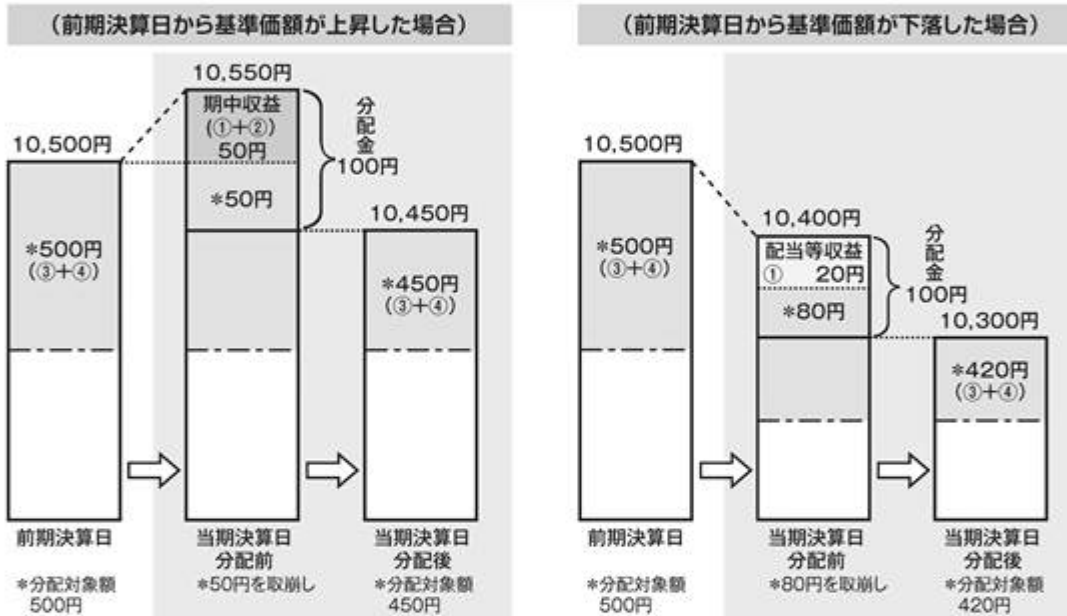
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



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

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

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成19年6月22日

信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

## 収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

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

1

## 収益分配金、償還金など お申込金(5)

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

運用指図

2

## 損益 信託金(5)

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

## 損益 投資

投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します(カッコ内は投資顧問会社名)。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ北米好配当株マザーファンド(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ欧州好配当株マザーファンド(パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド)</li> </ul>
------	---

(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

#### < 委託会社の概況（平成27年11月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

#### ・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

下記の各マザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券

4. ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

イ. 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざします。

ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の70%
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の0%
ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドの受益証券...	信託財産の純資産総額の5%
ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券	...信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券	...信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の10%

ただし、毎年6月末において、ダイワ日本国債マザーファンドのポートフォリオの最終利回りがダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのポートフォリオの最終利回りを上回った場合は、ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド受益証券の標準組入比率を信託財産の純資産総額の35%程度とし、ダイワ日本国債マザーファンド受益証券の標準組入比率を信託財産の純資産総額の35%程度とします。また、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

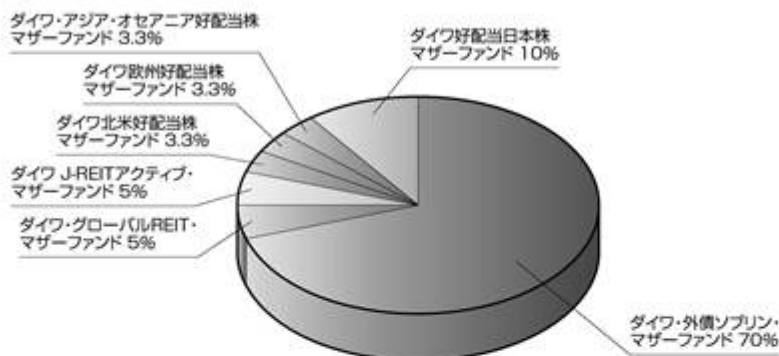
ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

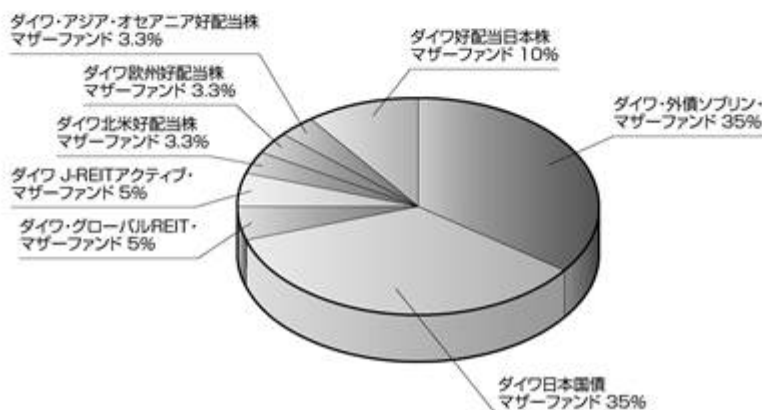
## 〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

ファンドにおける各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。



◆毎年6月末において、「ダイワ日本国債マザーファンド」の最終利回りが、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の最終利回りを上回った場合



## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

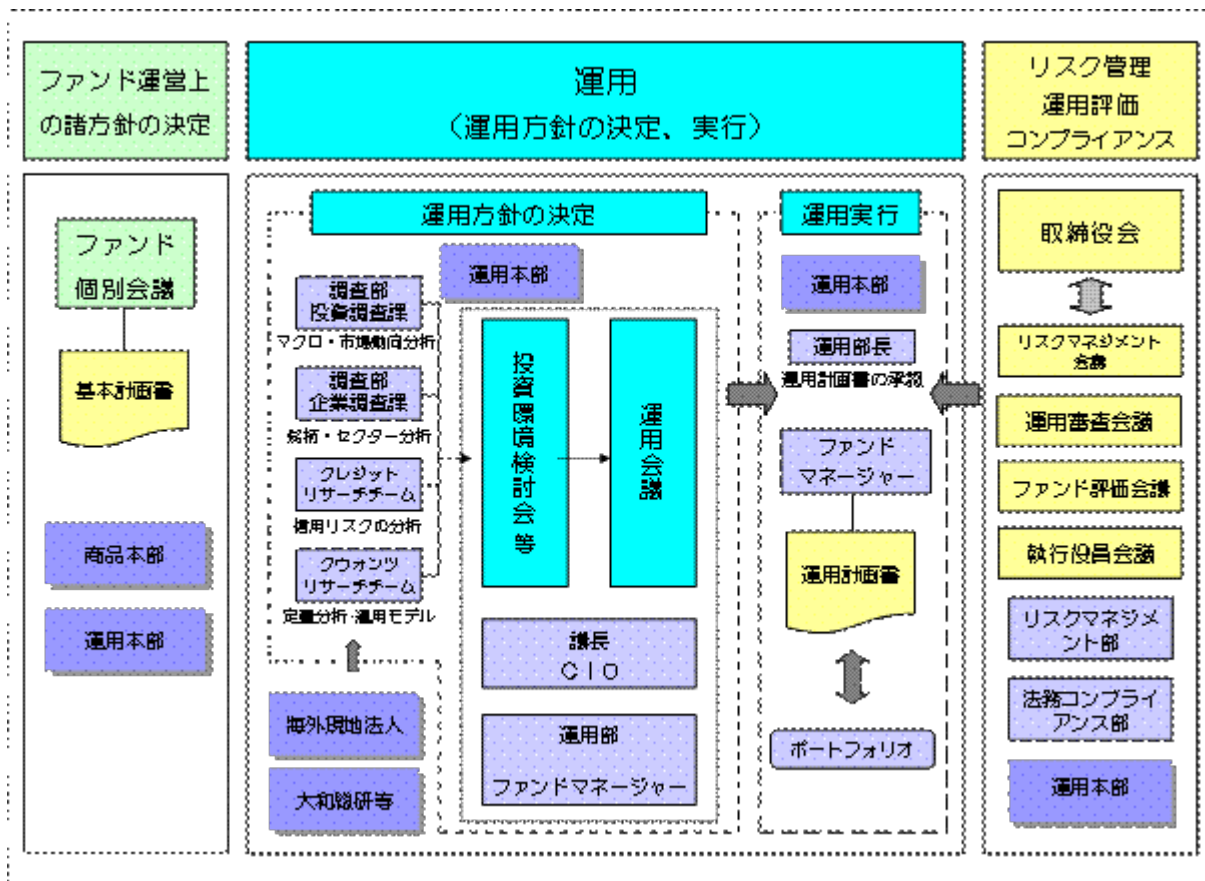
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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



## 八．基本的な運用方針の決定

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

## 二．運用計画書の作成・承認

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

## 職務権限

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

### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

### ロ．Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

### ハ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

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

### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

### ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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

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

### イ．ファンド評価会議

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

### ロ．運用審査会議

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

### ハ．リスクマネジメント会議

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

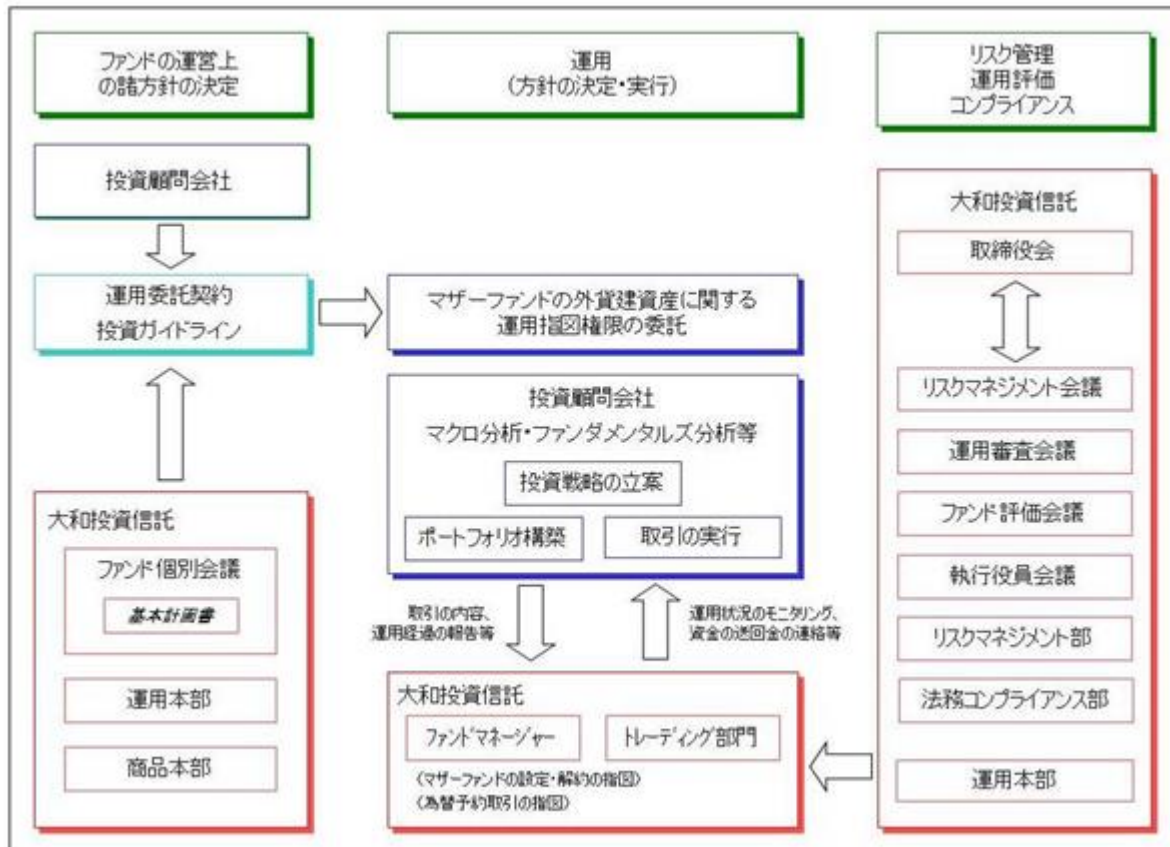
### ニ．執行役員会議

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

## 受託会社に対する管理体制

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

海外リート、海外（北米）株式および海外（欧州）株式にかかる運用体制について  
（マザーファンドにかかるものを含みます。）



### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

### ロ．運用の実行

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

### ハ．モニタリング

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

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

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

## 二．リスク管理、運用評価、コンプライアンス （前 に同じ。）

上記の運用体制は平成27年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

### (4) 【分配方針】

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

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。5月と11月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

### (5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> マザーファンドの概要

### 1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主として海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

ロ．海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。

a．米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。

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

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

b．ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします（ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。）。

c．国債については、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上（ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上）とすることを基本とします。

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

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

ハ．為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。

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

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限りま。

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限りま。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．コマーシャル・ペーパー

8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

10．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

12．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

13．外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

15．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号イもしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 2. ダイワ日本国債マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

1.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

2.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

委託会社は、信託金を、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2.~16.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

ロ.~ハ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

金利先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。



### 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

#### 4. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。

投資態度

イ. わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

ハ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）
- 2.（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
3. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

### (1) 投資方針

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

主要投資対象

北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ホ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

#### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

##### 主要投資対象

欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主として、欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

#### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

##### 主要投資対象

アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主として、アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

## (2) 投資対象

#### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）

#### 八．約束手形

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

#### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

##### イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券
13. 前12.以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券、前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前14.の証券および前15.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

委託会社は、信託金を、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. ~ 11. (ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

## &lt;各ファンド共通&gt;

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前（2）の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前（2）の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託

受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。



#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

### 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。

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

ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ニ．J-REIT（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

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

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

## イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証書
2. ～10.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. ～20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

## (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前（2）の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前（2）の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 〈基準価額の主な変動要因〉

株価変動リスク	株式市況	株 価	基準価額
	改 善	➡	上昇要因
	悪 化	➡	下落要因
公社債の 価格変動リスク	金 利	公社債価格	基準価額
	低 下	➡	上昇要因
	上 昇	➡	下落要因
リート の 価格変動リスク	リート市況	リート価格	基準価額
	改 善	➡	上昇要因
	悪 化	➡	下落要因
外貨建資産の 為替リスク	為替相場	円換算価値	基準価額
	円 安	➡	上昇要因
	円 高	➡	下落要因

○当ファンドの各資産の組入比率は標準組入比率を目処に決定されます。配分が大きい資産が下落する場合、他の資産が上昇しても、当ファンドの基準価額は下落する場合があります。

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

## 〈リーートの価格変動要因〉



イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

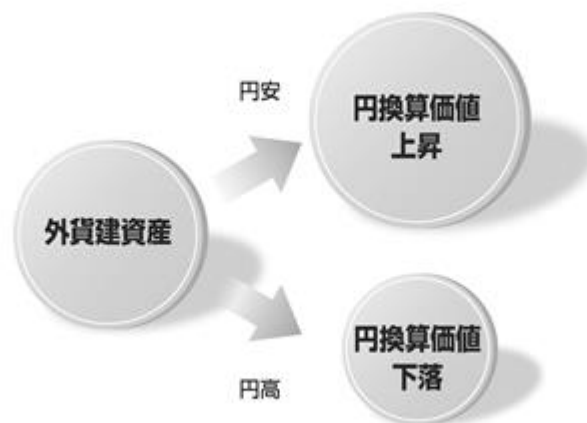
- ・リーートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リーートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リーートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリーートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リーートの価格が大幅に下落することも想定されます。

- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- 八．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リーートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リーートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもありえます。
- 二．組入リーートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

#### 外国証券への投資に伴うリスク

##### イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

##### ロ．カンントリー・リスク

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

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

## (2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

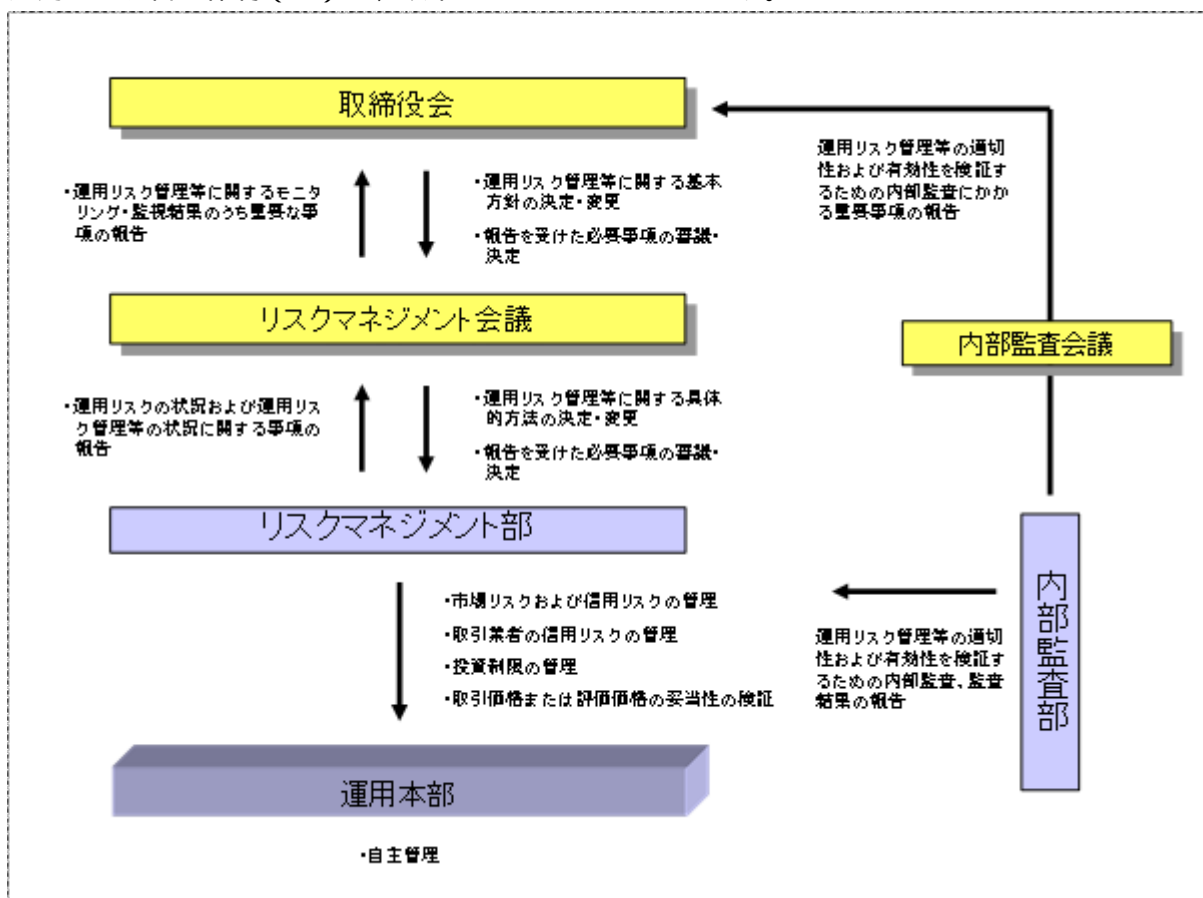
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

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

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

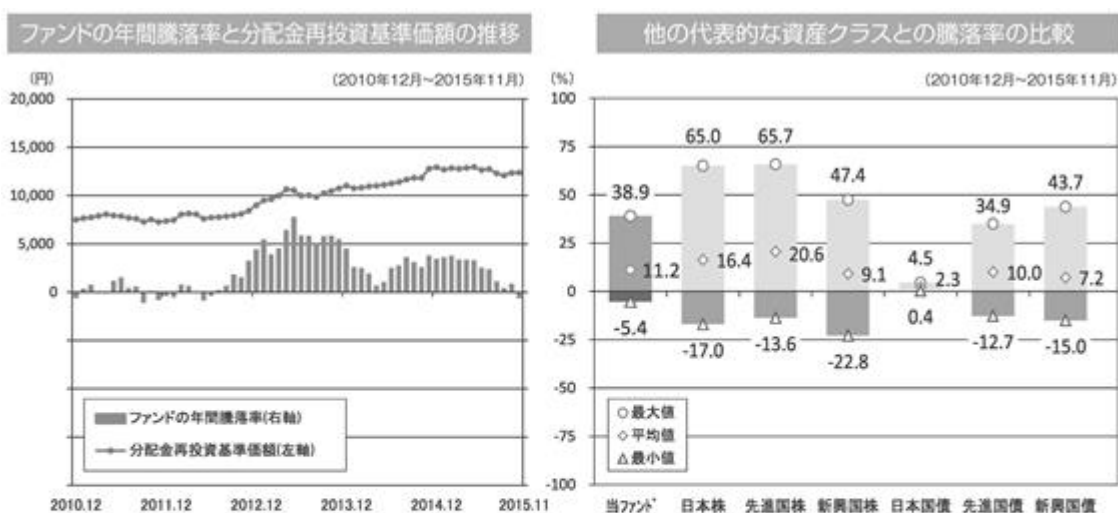


## 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(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年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。



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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.



## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

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

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.377%（税抜1.275%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社 （各販売会社の 取扱純資産総額 に応じて）	受託会社
100億円以下の部分	年率1.275%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.65% （税抜）	年率0.05% （税抜）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.70% （税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.75% （税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.80% （税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.85% （税抜）	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

#### イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

275億円以下の部分	年率0.57%
275億円超 1,000億円以下の部分	年率0.47%
1,000億円超 2,500億円以下の部分	年率0.37%
2,500億円超 4,500億円以下の部分	年率0.30%
4,500億円超の部分	年率0.25%

#### ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

## &lt; マザーファンドより支弁する手数料等 &gt;

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

## イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

## ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料(税込)を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

## ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

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

## 少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。N I S Aをご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年1月1日以降、年間120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

平成28年1月から年間80万円の範囲で20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアN I S A」の口座開設の申込受付が開始され、同年4月より投資可能となる予定です。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課

税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)には課税されません。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)となります。

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

( ) 上記は、平成27年11月末現在のものですので、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。

( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,038,903,061	99.15
内 日本	4,038,903,061	99.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	34,748,016	0.85
純資産総額	4,073,651,077	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】（平成27年11月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,653,196,858	1.7010 2,812,087,857	1.7141 2,833,744,734	69.56
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	159,664,193	2.5246 403,088,223	2.5331 404,445,367	9.93
3	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	91,753,848	2.1594 198,133,265	2.2261 204,253,241	5.01
4	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	96,916,302	2.0719 200,810,577	2.0819 201,770,049	4.95
5	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	61,940,553	2.1763 134,801,237	2.1660 134,163,237	3.29
6	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	83,809,190	1.5912 133,357,183	1.5827 132,644,805	3.26

7	ダイワ・アジア・オセアニア好配 当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	65,607,238	1.9472 127,750,413	1.9492 127,881,628	3.14
---	------------------------------	----	-------------------	------------	-----------------------	-----------------------	------

(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	99.15%
合計	99.15%

(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1特定期間末 (平成19年11月8日)	16,926,805,164	17,047,587,174	0.9682	0.9751
第2特定期間末 (平成20年5月8日)	16,081,449,143	16,209,998,397	0.8748	0.8818
第3特定期間末 (平成20年11月10日)	11,941,064,183	12,021,792,851	0.6656	0.6701
第4特定期間末 (平成21年5月8日)	12,147,547,474	12,191,754,830	0.6868	0.6893
第5特定期間末 (平成21年11月9日)	12,183,508,739	12,226,755,930	0.7041	0.7066
第6特定期間末 (平成22年5月10日)	11,656,331,795	11,697,595,626	0.7062	0.7087

第7特定期間末 (平成22年11月8日)	10,742,781,114	10,781,573,519	0.6923	0.6948
第8特定期間末 (平成23年5月9日)	9,788,415,300	9,823,277,364	0.7019	0.7044
第9特定期間末 (平成23年11月8日)	8,138,958,045	8,169,641,971	0.6631	0.6656
第10特定期間末 (平成24年5月8日)	7,463,333,638	7,490,331,852	0.6911	0.6936
第11特定期間末 (平成24年11月8日)	6,752,954,650	6,777,072,905	0.7000	0.7025
第12特定期間末 (平成25年5月8日)	7,693,068,615	7,714,023,613	0.9178	0.9203
第13特定期間末 (平成25年11月8日)	6,323,909,498	6,342,033,496	0.8723	0.8748
第14特定期間末 (平成26年5月8日)	5,716,045,140	5,731,474,692	0.9262	0.9287
第15特定期間末 (平成26年11月10日)	5,412,013,512	5,436,066,692	1.0125	1.0170
平成26年11月末日	5,425,819,284	-	1.0588	-
12月末日	5,291,394,425	-	1.0711	-
平成27年1月末日	5,045,331,198	-	1.0462	-
2月末日	5,024,286,113	-	1.0593	-
3月末日	4,824,242,729	-	1.0492	-
4月末日	4,744,627,235	-	1.0557	-
第16特定期間末 (平成27年5月8日)	4,645,698,964	4,665,887,169	1.0355	1.0400
5月末日	4,700,652,322	-	1.0590	-
6月末日	4,494,351,128	-	1.0345	-
7月末日	4,404,234,239	-	1.0378	-
8月末日	4,178,181,618	-	1.0018	-
9月末日	4,059,466,893	-	0.9793	-
10月末日	4,117,790,115	-	0.9995	-
第17特定期間末 (平成27年11月9日)	4,083,772,554	4,102,287,781	0.9925	0.9970
11月末日	4,073,651,077	-	0.9988	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
--	-------------

第1特定期間	0.0140
第2特定期間	0.0210
第3特定期間	0.0160
第4特定期間	0.0095
第5特定期間	0.0075
第6特定期間	0.0075
第7特定期間	0.0075
第8特定期間	0.0075
第9特定期間	0.0075
第10特定期間	0.0075
第11特定期間	0.0075
第12特定期間	0.0075
第13特定期間	0.0075
第14特定期間	0.0075
第15特定期間	0.0135
第16特定期間	0.0135
第17特定期間	0.0135

(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1特定期間	1.8
第2特定期間	7.5
第3特定期間	22.1
第4特定期間	4.6
第5特定期間	3.6
第6特定期間	1.4
第7特定期間	0.9
第8特定期間	2.5
第9特定期間	4.5
第10特定期間	5.4
第11特定期間	2.4
第12特定期間	32.2
第13特定期間	4.1
第14特定期間	7.0
第15特定期間	10.8



第16特定期間	3.6
第17特定期間	2.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	10,758,709,979	82,334,124
第2特定期間	1,246,564,378	346,218,062
第3特定期間	340,976,492	783,932,303
第4特定期間	145,918,578	399,312,549
第5特定期間	101,179,145	484,678,473
第6特定期間	92,887,476	890,218,215
第7特定期間	69,558,609	1,058,128,974
第8特定期間	53,398,256	1,625,534,474
第9特定期間	56,258,535	1,727,513,794
第10特定期間	39,112,672	1,513,397,602
第11特定期間	38,051,911	1,190,035,382
第12特定期間	40,474,871	1,305,777,564
第13特定期間	36,473,196	1,168,873,230
第14特定期間	28,614,946	1,106,393,289
第15特定期間	68,251,750	894,921,721
第16特定期間	37,102,265	895,985,499
第17特定期間	40,042,104	411,815,026

(注) 当初設定数量は6,805,990,092口です。

## (参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	45,956,016,396	94.81
内 ユーロ	13,485,650,026	27.82
内 ノルウェー	59,521,060	0.12
内 スウェーデン	1,564,022,661	3.23
内 デンマーク	441,233,817	0.91
内 イギリス	7,673,342,040	15.83
内 ポーランド	2,561,946,736	5.29

	内 カナダ	3,378,788,524	6.97
	内 アメリカ	12,752,929,811	26.31
	内 オーストラリア	4,038,581,721	8.33
特殊債券		468,523,697	0.97
	内 カナダ	468,523,697	0.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,045,682,355	4.22
純資産総額		48,470,222,448	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(%)
債券先物取引(買建)	6,217,993,295	12.83
内 イギリス	1,088,032,400	2.24
内 アメリカ	2,187,299,415	4.51
内 オーストラリア	2,942,661,480	6.07
債券先物取引(売建)	3,851,799,556	7.95
内 ドイツ	1,132,871,806	2.34
内 アメリカ	2,718,927,750	5.61
為替予約取引(買建)	5,778,784,964	11.92
内 日本	5,778,784,964	11.92
為替予約取引(売建)	5,880,601,471	12.13
内 日本	5,880,601,471	12.13

(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) 債券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。

(注4) 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 (平成27年11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	21,000,000	127.81 4,954,751,685	128.28 4,972,902,480	5.000000 2025/03/07	10.26
2	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	27,000,000	99.10 3,475,269,295	100.44 3,522,330,014	0.800000 2025/06/22	7.27

3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	28,000,000	99.36 3,417,097,541	97.99 3,369,905,683	2.000000 2025/08/15	6.95
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	25,000,000	100.33 3,080,786,175	99.14 3,044,093,700	2.125000 2025/05/15	6.28
5	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	32,500,000	104.50 2,992,947,334	103.33 2,959,525,621	3.250000 2025/04/21	6.11
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	20,000,000	113.05 2,936,658,234	113.77 2,955,445,376	2.250000 2022/10/25	6.10
7	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	16,800,000	123.39 2,692,520,979	123.94 2,704,481,888	5.000000 2020/10/18	5.58
8	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	13,500,000	108.48 2,703,430,080	108.36 2,700,439,560	2.750000 2024/09/07	5.57
9	US Treasury Inflation Indexed Bonds	アメリカ	国債証券	14,500,000	100.95 1,797,975,600	100.98 1,798,371,630	0.125000 2020/04/15	3.71
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	7,500,000	154.90 1,508,906,876	158.24 1,541,464,545	4.500000 2041/04/25	3.18
11	US Treasury Inflation Indexed Bonds	アメリカ	国債証券	12,500,000	97.46 1,496,395,760	96.99 1,489,151,410	0.250000 2025/01/15	3.07
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,000,000	97.35 1,195,739,058	97.46 1,197,101,976	2.875000 2045/08/15	2.47
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,000,000	128.87 1,004,302,944	133.25 1,038,421,771	3.250000 2045/05/25	2.14
14	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	32,000,000	103.72 1,010,078,205	105.43 1,026,722,806	3.250000 2025/07/25	2.12
15	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	10,000,000	110.14 1,011,020,955	109.58 1,005,871,536	2.750000 2022/06/01	2.08
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	101.56 997,907,587	100.45 987,010,996	2.250000 2024/11/15	2.04
17	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	9,000,000	106.54 880,178,899	105.99 875,635,294	2.250000 2025/06/01	1.81
18	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	110.52 840,844,803	110.78 842,758,850	4.000000 2023/10/25	1.74
19	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	5,000,000	119.39 775,338,142	121.00 785,793,482	3.400000 2024/03/18	1.62
20	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	45,500,000	116.99 746,823,213	116.23 742,003,557	2.500000 2025/05/12	1.53
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	20,000,000	113.19 688,874,340	113.78 692,465,080	5.500000 2019/10/25	1.43
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.62 617,962,112	100.00 614,100,000	1.625000 2020/07/31	1.27

23	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証 券	5,000,000	125.65 576,670,675	126.20 579,194,900	3.500000 2045/12/01	1.19
24	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オースト ラリア	国債証 券	5,700,000	113.28 569,027,497	111.97 562,452,600	4.250000 2026/04/21	1.16
25	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オースト ラリア	国債証 券	5,000,000	118.29 521,198,958	117.25 516,603,500	5.750000 2021/05/15	1.07
26	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証 券	5,000,000	112.54 516,502,330	111.78 513,032,668	3.250000 2021/06/01	1.06
27	Japan Bank For International Cooperation	カナダ	特殊債 券	5,000,000	102.61 470,951,542	102.08 468,523,697	2.300000 2018/03/19	0.97
28	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェー デン	国債証 券	30,000,000	106.65 448,915,104	107.71 453,372,435	1.500000 2023/11/13	0.94
29	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマー ク	国債証 券	23,000,000	108.67 435,167,302	110.19 441,233,817	1.750000 2025/11/15	0.91
30	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証 券	4,500,000	98.92 408,594,006	98.06 405,054,124	1.500000 2026/06/01	0.84

(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	94.81%
特殊債券	0.97%
合計	95.78%

(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
債券先物取引	アメリカ	T-NOTE(5YR) 2016年3月	買建	150	2,187,357,447	2,187,299,415	4.51%
	イギリス	GILT 10YR 2016年3月	買建	50	1,083,435,860	1,088,032,400	2.24%
	オーストラリア	A-BOND (3YR) 2015年12月	買建	300	2,942,751,362	2,942,661,480	6.07%
	アメリカ	T-NOTE(10YR) 2016年3月	売建	175	2,718,572,248	2,718,927,750	5.61%
	ドイツ	BUNDS 2015年12月	売建	55	1,120,723,870	1,132,871,806	2.34%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2015年12月	買建	29,530,645	2,713,704,833	2,708,846,081	5.59%
		米ドル買/円売 2015年12月	買建	3,609,109	442,900,000	442,981,977	0.91%
		ユーロ買/円売 2015年12月	買建	1,167,810	152,150,000	151,651,749	0.31%
		英ポンド買/円売 2015年12月	買建	822,136	152,650,000	151,675,791	0.31%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2015年12月	買建	10,847,255	152,650,000	152,186,987	0.31%
		豪ドル買/円売 2015年12月	買建	24,681,091	2,185,138,268	2,171,442,379	4.48%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2015年12月	売建	4,000,000	56,640,000	56,360,000	0.12%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2015年12月	売建	25,750,000	785,077,000	782,315,000	1.61%
		英ポンド売/円買 2015年12月	売建	3,000,000	557,460,000	553,470,000	1.14%
		デンマーク・クローネ売/円買 2015年12月	売建	400,000	6,976,560	6,964,000	0.01%
		ユーロ売/円買 2015年12月	売建	17,784,161	2,323,221,533	2,309,453,187	4.76%
		米ドル売/円買 2015年12月	売建	4,356,748	533,396,608	534,747,200	1.10%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2015年12月	売建	62,765,366	884,991,660	880,598,084	1.82%
豪ドル売/円買 2015年12月	売建	8,600,000	760,119,700	756,694,000	1.56%		

(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) 債券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。

(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。

(注4) 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・グローバルREIT・マザーファンド

### (1) 投資状況 (平成27年11月30日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	154,449,726,682	98.15
内 香港	4,796,613,731	3.05
内 シンガポール	6,330,654,236	4.02
内 イギリス	18,164,907,839	11.54
内 オランダ	3,938,498,255	2.50
内 ベルギー	825,102,474	0.52
内 フランス	11,703,702,258	7.44
内 ドイツ	1,874,213,529	1.19
内 スペイン	2,268,334,618	1.44
内 イタリア	1,772,132,703	1.13
内 カナダ	725,776,084	0.46
内 アメリカ	81,316,920,633	51.67
内 オーストラリア	20,732,870,322	13.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,915,558,379	1.85
純資産総額	157,365,285,061	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)	154,057,830	0.10
内 日本	154,057,830	0.10
為替予約取引(売建)	154,468,470	0.10
内 日本	154,468,470	0.10

(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（平成27年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	457,078	22,146.16 10,122,528,396	23,335.80 10,666,280,792	6.78
2	KLEPIERRE	フランス	投資証券	1,630,731	4,989.08 8,135,861,043	5,508.86 8,983,469,102	5.71
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	760,020	8,668.63 6,588,336,429	9,905.43 7,528,327,189	4.78
4	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	2,967,665	2,235.50 6,634,232,913	2,276.11 6,754,755,724	4.29
5	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	555,982	9,008.84 5,008,762,948	10,308.28 5,731,219,577	3.64
6	VICINITY CENTRES	オーストラリア	投資証券	21,959,491	239.68 5,265,023,290	242.33 5,321,443,454	3.38
7	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	13,680,194	335.73 4,592,950,029	357.76 4,894,324,703	3.11
8	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	400,405	10,895.11 4,362,467,343	11,981.09 4,797,288,742	3.05
9	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	4,080,106	1,126.98 4,598,210,100	1,124.21 4,586,912,287	2.91
10	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	954,954	4,421.52 4,222,348,210	4,718.74 4,506,183,840	2.86
11	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	4,888,849	859.17 4,200,352,395	845.95 4,135,731,589	2.63
12	LINK REIT	香港	投資証券	5,178,420	661.72 3,426,702,841	747.32 3,869,975,673	2.46

13	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	254,282	12,861.71 3,270,501,444	14,605.75 3,713,980,440	2.36
14	DDR CORP	アメリカ	投資証券	1,692,407	1,860.72 3,149,100,630	2,116.18 3,581,452,400	2.28
15	CUBESMART	アメリカ	投資証券	779,483	3,129.94 2,439,745,162	3,599.85 2,806,025,151	1.78
16	WERELDHAVE NV	オランダ	投資証券	394,012	6,429.06 2,533,126,789	6,917.40 2,725,542,076	1.73
17	FONCIERE DES REGIONS	フランス	投資証券	250,949	9,617.61 2,413,530,616	10,839.78 2,720,233,156	1.73
18	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	1,327,005	2,171.45 2,881,535,092	2,041.26 2,708,773,373	1.72
19	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	300,432	8,066.94 2,423,602,925	8,318.59 2,499,173,215	1.59
20	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	アメリカ	投資証券	583,150	4,124.41 2,405,161,142	4,248.34 2,477,421,687	1.57
21	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	3,608,631	671.38 2,422,939,364	681.16 2,458,082,518	1.56
22	BIG YELLOW GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,689,619	1,250.66 2,113,147,348	1,445.41 2,442,205,716	1.55
23	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	312,964	7,780.64 2,435,062,408	7,760.99 2,428,912,290	1.54
24	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	288,232	7,288.13 2,100,674,823	8,365.27 2,411,138,560	1.53
25	DERWENT LONDON PLC	イギリス	投資証券	347,534	6,621.60 2,301,231,829	6,926.19 2,407,087,211	1.53
26	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	117,971	16,779.42 1,979,491,749	18,165.07 2,142,952,417	1.36
27	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	249,391	7,970.03 1,987,664,322	8,281.75 2,065,394,563	1.31
28	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	187,253	9,892.90 1,852,489,420	10,980.10 2,056,058,163	1.31
29	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	15,935,070	117.84 1,878,030,143	123.63 1,970,052,704	1.25
30	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	ドイツ	投資証券	1,160,929	1,478.68 1,716,747,255	1,614.40 1,874,213,529	1.19

(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	98.15%
合計	98.15%

(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	ユーロ買/円売 2015年12月	買建	253,979	33,071,606	32,984,296	0.02%
		豪ドル買/円売 2015年12月	買建	1,374,274	121,409,443	121,073,534	0.08%
		米ドル売/円買 2015年12月	売建	1,257,784	154,481,049	154,468,470	0.10%

(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J-REITアクティブ・マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		74,971,647,000	97.52
	内 日本	74,971,647,000	97.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,908,830,022	2.48
純資産総額		76,880,477,022	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（平成27年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	9,000	538,550.70 4,846,956,310	586,000.00 5,274,000,000	6.86
2	日本リテールファンド	日本	投資証券	19,000	230,604.30 4,381,481,737	235,500.00 4,474,500,000	5.82
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	28,000	154,594.20 4,328,637,923	148,500.00 4,158,000,000	5.41
4	日本ビルファンド	日本	投資証券	6,800	553,600.80 3,764,485,490	581,000.00 3,950,800,000	5.14
5	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	32,000	87,400.00 2,796,800,000	89,700.00 2,870,400,000	3.73
6	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,000	164,400.00 2,630,400,000	164,000.00 2,624,000,000	3.41
7	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	34,000	70,000.00 2,380,000,000	74,100.00 2,519,400,000	3.28
8	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,700	391,500.00 2,231,550,000	425,000.00 2,422,500,000	3.15
9	GLP投資法人	日本	投資証券	20,000	118,700.00 2,374,000,000	120,100.00 2,402,000,000	3.12
10	API投資法人	日本	投資証券	4,600	497,500.00 2,288,500,000	506,000.00 2,327,600,000	3.03
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	14,000	159,600.00 2,234,400,000	160,900.00 2,252,600,000	2.93

12	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	25,000	80,778.68 2,019,467,014	86,700.00 2,167,500,000	2.82
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,000	267,000.00 2,136,000,000	262,400.00 2,099,200,000	2.73
14	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	20,000	97,400.00 1,948,000,000	100,500.00 2,010,000,000	2.61
15	日本プロロジスリート	日本	投資証券	9,000	219,100.00 1,971,900,000	215,900.00 1,943,100,000	2.53
16	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	3,200	605,000.00 1,936,000,000	607,000.00 1,942,400,000	2.53
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	12,000	148,881.47 1,786,577,659	157,900.00 1,894,800,000	2.46
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	7,000	227,900.00 1,595,300,000	235,900.00 1,651,300,000	2.15
19	産業ファンド	日本	投資証券	3,000	549,000.00 1,647,000,000	550,000.00 1,650,000,000	2.15
20	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,000	533,000.00 1,599,000,000	542,000.00 1,626,000,000	2.11
21	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	3,850	353,000.00 1,359,050,000	378,500.00 1,457,225,000	1.90
22	森トラスト総合リート	日本	投資証券	6,600	212,400.00 1,401,840,000	206,500.00 1,362,900,000	1.77
23	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	2,800	397,000.00 1,111,600,000	454,500.00 1,272,600,000	1.66
24	トップリート投資法人	日本	投資証券	2,800	458,000.00 1,282,400,000	452,000.00 1,265,600,000	1.65
25	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	3,000	420,500.00 1,261,500,000	420,500.00 1,261,500,000	1.64
26	日本リート投資法人	日本	投資証券	4,000	287,500.00 1,150,000,000	298,300.00 1,193,200,000	1.55
27	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	9,000	126,000.00 1,134,000,000	128,700.00 1,158,300,000	1.51
28	プレミア投資法人	日本	投資証券	9,500	115,900.00 1,101,050,000	121,200.00 1,151,400,000	1.50
29	いちごオフィスリート投資法人	日本	投資証券	13,000	83,800.00 1,089,400,000	88,500.00 1,150,500,000	1.50
30	大和ハウスリート	日本	投資証券	2,300	492,038.68 1,131,688,979	488,000.00 1,122,400,000	1.46

(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	97.52%
合計	97.52%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,512,830,212	71.55
内 カナダ	37,527,148	1.77
内 アメリカ	1,475,303,064	69.78
ハイブリッド優先証券	502,144,168	23.75
内 アメリカ	502,144,168	23.75
投資証券	46,935,434	2.22
内 アメリカ	46,935,434	2.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	52,392,979	2.48
純資産総額	2,114,302,793	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（平成27年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	4,200	13,535.99 56,851,167	14,469.42 60,771,582	2.87
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	5,734	9,845.25 56,452,670	9,976.66 57,206,218	2.71
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	7,100	5,733.23 40,705,987	6,623.68 47,028,146	2.22
4	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	3,000	12,580.45 37,741,358	13,198.23 39,594,712	1.87
5	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,800	9,152.79 34,780,905	9,805.94 37,262,605	1.76
6	TE CONNECTIVITY LTD	アメリカ	株式	情報技術	4,500	7,557.11 34,007,016	8,270.69 37,218,145	1.76
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,500	7,367.97 33,155,873	8,249.81 37,124,187	1.76
8	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	8,900	4,086.22 36,367,370	4,123.06 36,695,300	1.74
9	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	5,226	6,325.23 33,055,652	6,802.99 35,552,477	1.68
10	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,000	14,771.56 29,543,123	16,548.76 33,097,534	1.57
11	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	アメリカ	株式	情報技術	2,000	14,573.69 29,147,581	15,971.51 31,943,026	1.51
12	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	アメリカ	株式	金融	4,500	6,708.42 30,187,928	6,982.31 31,420,427	1.49
13	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,200	12,985.75 28,568,669	14,140.26 31,108,587	1.47
14	AETNA INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,400	13,646.53 32,751,672	12,780.64 30,673,558	1.45

15	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	2,462	12,396.22 30,519,500	12,204.62 30,047,783	1.42
16	CVS HEALTH CORP	アメリカ	株式	生活必需品	2,575	12,337.26 31,768,468	11,622.45 29,927,826	1.42
17	HANESBRANDS INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	7,700	3,535.98 27,227,106	3,838.12 29,553,563	1.40
18	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,300	6,084.50 26,163,362	6,627.36 28,497,679	1.35
19	AMERIPRISE FINANCIAL INC	アメリカ	株式	金融	2,000	13,211.74 26,423,495	13,941.29 27,882,596	1.32
20	ANALOG DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	3,600	7,463.52 26,868,902	7,424.46 26,728,088	1.26
21	BLACKROCK INC	アメリカ	株式	金融	600	39,605.76 23,763,459	44,017.45 26,410,476	1.25
22	ROSS STORES INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	4,000	5,956.77 23,827,080	6,467.70 25,870,805	1.22
23	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,616	8,867.60 23,197,652	9,390.81 24,566,378	1.16
24	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	2,600	9,114.47 23,697,628	9,297.47 24,173,432	1.14
25	ACE LTD	アメリカ	株式	金融	1,700	12,963.65 22,038,207	14,131.66 24,023,838	1.14
26	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	アメリカ	株式	エネルギー	2,600	9,076.39 23,598,635	9,234.83 24,010,573	1.14
27	CITIGROUP CAPITAL XIII 6.6919	アメリカ	ハイブリッド優先証券	-	7,491	3,168.38 23,734,971	3,190.86 23,902,759	1.13
28	GENERAL DYNAMICS CORP	アメリカ	株式	資本財・サービス	1,300	17,281.51 22,466,112	17,877.67 23,240,983	1.10
29	FORD MOTOR CO	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,900	1,843.52 23,781,514	1,784.57 23,021,012	1.09
30	ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40	アメリカ	ハイブリッド優先証券	-	7,325	3,134.36 22,959,234	3,129.45 22,923,248	1.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	71.55%
ハイブリッド優先証券	23.75%
投資証券	2.22%
合計	97.52%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.13%
素材	2.45%
資本財・サービス	6.38%
一般消費財・サービス	8.54%
生活必需品	5.79%
ヘルスケア	9.25%
金融	13.37%
情報技術	14.79%
電気通信サービス	1.74%
公益事業	3.12%
合計	71.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,396,482,085	93.19
内 ノルウェー	22,548,399	1.50
内 スウェーデン	131,173,631	8.75

内 デンマーク	26,164,020	1.75
内 イギリス	430,040,606	28.70
内 オランダ	95,676,509	6.38
内 フランス	157,730,249	10.53
内 ドイツ	224,564,669	14.99
内 スイス	208,951,857	13.94
内 ポルトガル	23,815,222	1.59
内 スペイン	37,349,520	2.49
内 イタリア	21,523,121	1.44
内 オーストリア	16,944,282	1.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	102,103,292	6.81
純資産総額	1,498,585,377	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（平成27年11月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	7,685	8,860.28 68,091,325	9,104.58 69,968,759	4.67
2	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	5,611	10,421.41 58,474,568	10,576.33 59,343,830	3.96
3	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	7,264	6,898.50 50,110,719	7,196.63 52,276,328	3.49
4	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	52,046	951.79 49,537,257	987.42 51,391,542	3.43
5	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	電気通信サービス	21,145	1,899.49 40,164,821	2,270.30 48,005,544	3.20
6	BAYER AG-REG	ドイツ	株式	ヘルスケア	2,789	14,027.04 39,121,415	16,338.90 45,569,203	3.04
7	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	4,064	11,033.30 44,839,356	10,887.84 44,248,183	2.95
8	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	5,987	6,899.22 41,305,664	7,275.87 43,560,679	2.91



9	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,696.08 40,020,656	2,858.53 42,432,034	2.83
10	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,424.72 38,553,064	2,520.71 40,079,337	2.67
11	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	イギリス	株式	生活必需品	3,420	11,140.61 38,100,886	11,646.41 39,830,736	2.66
12	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,829	9,096.79 34,831,629	10,115.05 38,730,543	2.58
13	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	848.05 34,489,442	946.99 38,513,462	2.57
14	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	スウェーデン	株式	生活必需品	10,734	3,104.83 33,327,342	3,566.42 38,282,017	2.55
15	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	22,159	1,674.69 37,109,481	1,721.57 38,148,482	2.55
16	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	90,005	376.76 33,911,057	416.82 37,516,496	2.50
17	ENAGAS SA	スペイン	株式	公益事業	10,115	3,442.46 34,820,577	3,692.48 37,349,520	2.49
18	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	6,577.12 30,754,628	7,655.12 35,795,375	2.39
19	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	資本財・サービス	10,209	2,867.75 29,276,864	3,352.85 34,229,267	2.28
20	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	5,636	5,797.19 32,672,984	6,055.00 34,126,012	2.28
21	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,541	18,741.68 28,880,935	21,728.92 33,484,272	2.23
22	SWEDBANK AB - A SHARES	スウェーデン	株式	金融	12,350	2,661.49 32,869,414	2,695.16 33,285,263	2.22
23	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,005	29,756.74 29,905,533	32,426.15 32,588,288	2.17
24	KONINKLIJKE AHOLD NV	オランダ	株式	生活必需品	11,875	2,248.22 26,697,646	2,676.82 31,787,318	2.12
25	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,489	10,872.25 27,061,042	12,581.47 31,315,293	2.09
26	ATLAS COPCO AB-B SHS	スウェーデン	株式	資本財・サービス	10,292	2,740.05 28,200,687	3,013.64 31,016,424	2.07
27	REXAM PLC	イギリス	株式	素材	29,192	987.61 28,830,311	1,053.14 30,743,350	2.05

28	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	9,924	3,264.65 32,398,397	3,057.89 30,346,590	2.03
29	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	201,397.30 27,792,827	219,868.65 30,341,874	2.02
30	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	4,772	5,901.74 28,163,138	6,215.40 29,659,924	1.98

(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	93.19%
合計	93.19%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.74%
素材	9.75%
資本財・サービス	11.55%
一般消費財・サービス	5.66%
生活必需品	15.49%
ヘルスケア	12.63%
金融	19.87%
電気通信サービス	7.45%
公益事業	5.04%
合計	93.19%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,058,957,524	93.58
内 韓国	228,435,807	20.19
内 中国	130,555,182	11.54
内 台湾	215,996,945	19.09
内 香港	42,878,688	3.79
内 シンガポール	84,327,162	7.45
内 オーストラリア	356,763,740	31.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	72,691,514	6.42
純資産総額	1,131,649,038	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（平成27年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	AMCOR LIMITED	オーストラリア	株式	素材	68,000	1,149.96 78,197,688	1,211.65 82,392,200	7.28
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	470	133,174.80 62,592,156	140,927.40 66,235,878	5.85
3	CRUCIALTEC CO LTD	韓国	株式	情報技術	35,743	1,556.67 55,640,359	1,603.62 57,318,190	5.07
4	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	台湾	株式	情報技術	196,250	308.32 60,507,800	289.52 56,818,300	5.02
5	YESTAR INTERNATIONAL HOLDING	中国	株式	資本財・サービス	779,000	47.86 37,288,393	55.15 42,968,082	3.80
6	CELLTRION INC	韓国	株式	ヘルスケア	4,500	8,231.49 37,041,726	9,292.50 41,816,250	3.70
7	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	80,000	513.24 41,059,200	522.64 41,811,200	3.69
8	SHENG SIONG GROUP LTD	シンガポール	株式	生活必需品	500,000	74.26 37,132,650	71.65 35,829,750	3.17

9	GENERAL INTERFACE SOLUTION	台湾	株式	情報技術	60,000	511.96 30,717,918	530.16 31,809,600	2.81
10	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	台湾	株式	生活必需品	40,000	795.24 31,809,600	789.60 31,584,000	2.79
11	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	4,173	6,570.22 27,417,558	7,060.17 29,462,108	2.60
12	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	10,000	2,664.39 26,644,773	2,830.41 28,304,144	2.50
13	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	10,800	2,776.66 29,987,941	2,616.28 28,255,854	2.50
14	CROWN CONFECTIONERY CO LTD	韓国	株式	生活必需品	520	72,314.31 37,603,444	53,737.20 27,943,344	2.47
15	TRANSURBAN GROUP	オーストラリア	株式	資本財・サービス	30,000	889.48 26,686,603	926.14 27,784,236	2.46
16	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	8,000	3,545.06 28,360,541	3,376.75 27,014,067	2.39
17	SONIC HEALTHCARE LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	14,000	1,641.67 22,983,458	1,775.61 24,858,652	2.20
18	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	17,000	1,513.96 25,737,487	1,441.87 24,511,892	2.17
19	INNOVALUES LTD	シンガポール	株式	一般消費財・サービス	350,000	60.62 21,233,277	65.14 22,800,750	2.01
20	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	30,000	695.02 20,850,675	737.02 22,110,750	1.95
21	MEDY-TOX INC	韓国	株式	ヘルスケア	420	49,687.03 20,868,553	51,039.72 21,436,682	1.89
22	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	中国	株式	一般消費財・サービス	160,000	131.55 21,048,800	132.66 21,226,320	1.88
23	FIH MOBILE LTD	香港	株式	情報技術	358,000	60.16 21,544,019	58.01 20,767,938	1.84
24	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	中国	株式	一般消費財・サービス	300,000	58.96 17,688,600	64.03 19,210,200	1.70
25	SG FLEET GROUP LTD	オーストラリア	株式	資本財・サービス	56,000	317.49 17,782,354	326.04 18,258,464	1.61
26	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	台湾	株式	金融	91,461	146.82 13,429,036	165.44 15,131,308	1.34

27	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	47,250	323.73 15,296,526	319.60 15,101,100	1.33
28	CSL LTD	オースト リア	株式	ヘルスケ ア	1,700	7,864.71 13,370,007	8,781.15 14,927,969	1.32
29	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技 術	6,000	2,452.86 14,717,202	2,428.22 14,569,320	1.29
30	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	台湾	株式	一般消 費財・ サービス	21,000	663.64 13,936,440	686.20 14,410,200	1.27

(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	93.58%
合計	93.58%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.06%
素材	9.71%
資本財・サービス	7.97%
一般消費財・サービス	8.34%
生活必需品	10.81%
ヘルスケア	9.11%
金融	16.07%
情報技術	29.40%
公益事業	1.10%
その他	0.01%
合計	93.58%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ好配当日本株マザーファンド

## (1) 投資状況（平成27年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		44,332,622,300	91.50
	内 日本	44,332,622,300	91.50
投資証券		2,344,907,500	4.84
	内 日本	2,344,907,500	4.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,773,028,910	3.66
純資産総額		48,450,558,710	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（平成27年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,018,200	1,197.00 1,218,785,400	1,314.50 1,338,423,900	2.76
2	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	274,700	4,301.00 1,181,484,700	4,565.00 1,254,005,500	2.59
3	あおぞら銀行	日本	株式	銀行業	2,773,000	430.40 1,193,531,200	434.00 1,203,482,000	2.48
4	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	-	13,335	80,100.00 1,068,133,500	89,700.00 1,196,149,500	2.47
5	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	-	2,612	318,000.00 830,616,000	378,500.00 988,642,000	2.04
6	伊藤忠	日本	株式	卸売業	584,400	1,474.35 861,613,320	1,502.00 877,768,800	1.81
7	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	106,700	7,251.00 773,681,700	7,657.00 817,001,900	1.69
8	テクノプロ・ホールディング	日本	株式	サービス業	219,900	3,190.00 701,481,000	3,510.00 771,849,000	1.59

9	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	158,700	4,621.00 733,352,700	4,697.00 745,413,900	1.54
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,858,600	237.07 677,711,085	248.50 710,362,100	1.47
11	マツダ	日本	株式	輸送用機器	266,000	2,294.96 610,460,450	2,557.50 680,295,000	1.40
12	河西工業	日本	株式	輸送用機器	330,000	1,441.00 475,530,000	1,861.00 614,130,000	1.27
13	MS & AD	日本	株式	保険業	159,900	3,511.35 561,465,529	3,472.00 555,172,800	1.15
14	関東電化	日本	株式	化学	563,000	851.00 479,119,000	911.00 512,893,000	1.06
15	アルプス電気	日本	株式	電気機器	125,000	3,378.64 422,330,332	3,870.00 483,750,000	1.00
16	村田製作所	日本	株式	電気機器	25,100	15,990.45 401,360,464	19,100.00 479,410,000	0.99
17	日本航空	日本	株式	空運業	113,800	4,300.71 489,421,638	4,210.00 479,098,000	0.99
18	トラスト・テック	日本	株式	サービス業	181,500	2,177.00 395,125,500	2,507.00 455,020,500	0.94
19	大和ハウス	日本	株式	建設業	132,400	3,053.00 404,217,200	3,429.00 453,999,600	0.94
20	第一生命	日本	株式	保険業	212,000	2,086.13 442,260,113	2,130.00 451,560,000	0.93
21	寺崎電気産業	日本	株式	電気機器	357,200	1,208.00 431,497,600	1,185.00 423,282,000	0.87
22	SRAホールディングス	日本	株式	情報・通信業	152,800	2,076.00 317,212,800	2,707.00 413,629,600	0.85
23	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	79,700	4,577.70 364,843,204	5,088.00 405,513,600	0.84
24	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	498,500	741.70 369,737,450	790.00 393,815,000	0.81
25	丸紅建材リース	日本	株式	卸売業	1,755,000	228.00 400,140,000	224.00 393,120,000	0.81
26	ケー・エフ・シー	日本	株式	金属製品	155,100	2,869.00 444,981,900	2,527.00 391,937,700	0.81
27	シノケングループ	日本	株式	不動産業	220,700	1,783.00 393,508,100	1,767.00 389,976,900	0.80
28	扶桑化学工業	日本	株式	化学	223,000	1,475.00 328,925,000	1,663.00 370,849,000	0.77

29	サムティ	日本	株式	不動産業	297,200	1,147.07 340,911,730	1,241.00 368,825,200	0.76
30	東ソー	日本	株式	化学	528,000	620.00 327,360,000	690.00 364,320,000	0.75

(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	91.50%
投資証券	4.84%
合計	96.34%

(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	7.54%
食料品	0.26%
繊維製品	0.73%
化学	8.21%
医薬品	1.42%
石油・石炭製品	0.66%
ゴム製品	0.27%
ガラス・土石製品	1.69%
鉄鋼	1.12%
非鉄金属	0.48%
金属製品	2.48%
機械	3.21%
電気機器	7.87%
輸送用機器	9.38%
その他製品	2.14%
陸運業	1.27%
空運業	0.99%
倉庫・運輸関連業	0.33%



情報・通信業	7.54%
卸売業	11.47%
小売業	1.53%
銀行業	7.71%
保険業	2.08%
その他金融業	0.27%
不動産業	3.38%
サービス業	7.48%
合計	91.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

2015年11月30日現在

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

##### 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,988円
純資産総額	40億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	0.6%
6カ月間	-4.4%
1年間	-3.1%
3年間	46.7%
5年間	63.7%
設定来	23.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において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: 270円 設定来分配金合計額: 1,760円

決算期	第40期 14年1月	第41期 14年3月	第42期 14年5月	第43期 14年7月	第44期 14年9月	第45期 14年11月	第46期 15年1月	第47期 15年3月	第48期 15年5月	第49期 15年7月	第50期 15年9月	第51期 15年11月
分配金	25円	25円	25円	45円	45円	45円	45円	45円	45円	45円	45円	45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	国・地域名	比率	
外国債券・先物	42	70.0%	米ドル	25.0%	直接利回り(%)	日産自動車	日本	0.3%	
国内株式	196	9.1%	ユーロ	19.0%	最終利回り(%)	日本電信電話	日本	0.3%	
外国株式	154	8.3%	日本円	16.4%	修正デュレーション	あおぞら銀行	日本	0.2%	
外国リート等	126	5.7%	英ポンド	12.4%	残存年数	AMCOR LIMITED	オーストラリア	0.2%	
国内リート	50	5.4%	豪ドル	9.9%	債券格付別構成	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%	
			カナダ・ドル	9.6%	AAA	64.4%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	0.4%
			ポーランド・ズロチ	2.6%	AA	21.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.6%	A	14.4%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
			香港ドル	0.7%	BBB	-	MCUBS MidCity投資法人	日本	0.3%
コール・ローン、その他		4.9%	その他	2.9%	BB	-	日本リテールファンド	日本	0.3%
合計	568	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.9%	

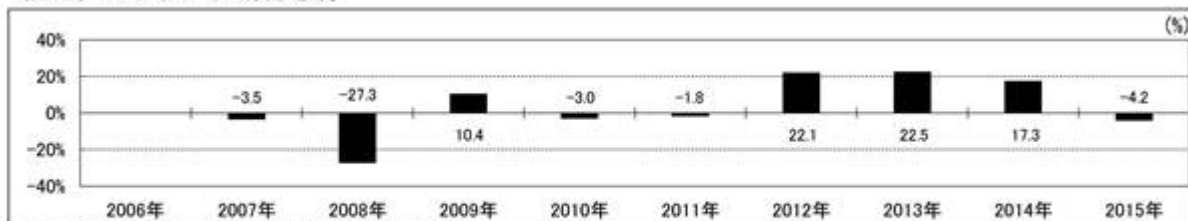
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&amp;Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2007年は設定日(6月22日)から年末、2015年は11月30日までの騰落率を表しています。

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



## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

### 2 【換金(解約)手続等】

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

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

<一部解約>

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問い合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価(注1、注2)により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次の1.~3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年1月9日から3月8日まで、3月9日から5月8日まで、5月9日から7月8日まで、7月9日から9月8日まで、9月9日から11月8日まで、および11月9日から翌年1月8日までとします。ただし、第1計算期間は、平成19年6月22日から平成19年7月8日までとします。

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

## (5) 【その他】

## 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

## 信託約款の変更

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

す。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年5月および11月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権



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

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

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

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

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

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年5月9日から平成27年11月9日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	66,193,271	64,172,418
親投資信託受益証券	4,608,715,630	4,049,992,725
未収入金	8,000,000	-
流動資産合計	4,682,908,901	4,114,165,143
資産合計	4,682,908,901	4,114,165,143
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	20,188,205	18,515,227
未払解約金	5,948,716	2,118,380
未払受託者報酬	426,328	375,705
未払委託者報酬	10,445,436	9,205,178
その他未払費用	201,252	178,099
流動負債合計	37,209,937	30,392,589
負債合計	37,209,937	30,392,589
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,486,267,896	1 4,114,494,974
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 159,431,068	2 30,722,420
（分配準備積立金）	379,352,054	323,326,674
元本等合計	4,645,698,964	4,083,772,554
純資産合計	4,645,698,964	4,083,772,554
負債純資産合計	4,682,908,901	4,114,165,143

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	自 至	前 期 平成26年11月11日 平成27年5月8日	自 至	当 期 平成27年5月9日 平成27年11月9日
<b>営業収益</b>				
受取利息		14,221		13,072
有価証券売買等損益		232,699,716		92,722,905
<b>営業収益合計</b>		<b>232,713,937</b>		<b>92,709,833</b>
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		1,342,245		1,187,943
委託者報酬		1 32,886,004		1 29,105,506
その他費用		201,252		178,099
<b>営業費用合計</b>		<b>34,429,501</b>		<b>30,471,548</b>
営業利益又は営業損失（ ）		198,284,436		123,181,381
経常利益又は経常損失（ ）		198,284,436		123,181,381
当期純利益又は当期純損失（ ）		198,284,436		123,181,381
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		16,771,538		4,393,724
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		66,862,382		159,431,068
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,706,246		858,169
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,706,246		858,169
剰余金減少額又は欠損金増加額		27,213,752		6,653,260
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		27,213,752		6,653,260
分配金		2 63,436,706		2 56,783,292
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		159,431,068		30,722,420

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成27年5月9日	至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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  平成27年11月8日が休日のため、当特定期間末日を平成27年11月9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
	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首元本額	5,345,151,130円	4,486,267,896円
期中追加設定元本額	37,102,265円	40,042,104円
期中一部解約元本額	895,985,499円	411,815,026円
2. 特定期間末日における受益権の総数	4,486,267,896口	4,114,494,974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30,722,420円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成26年11月11日 至 平成27年5月8日	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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	1,358,361円	1,201,278円
2.	2 分配金の計算過程	<p>(自平成26年11月11日 至平成27年1月8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(22,904,604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(115,793,633円)、投資信託約款に規定される収益調整金(16,799,526円)及び分配準備積立金(320,685,459円)より分配対象額は476,183,222円(1万口当たり969.87円)であり、うち22,093,917円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年5月9日 至平成27年7月8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(10,856,553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(18,373,613円)及び分配準備積立金(365,019,946円)より分配対象額は394,250,112円(1万口当たり909.36円)であり、うち19,509,570円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>

<p>(自平成27年1月9日 至平成27年3月9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(9,470,555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(17,338,263円)及び分配準備積立金(417,453,569円)より分配対象額は444,262,387円(1万口当たり945.03円)であり、うち21,154,584円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年7月9日 至平成27年9月8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(8,271,276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(18,305,803円)及び分配準備積立金(342,011,573円)より分配対象額は368,588,652円(1万口当たり884.21円)であり、うち18,758,495円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成27年3月10日 至平成27年5月8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(13,115,353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(17,360,689円)及び分配準備積立金(386,424,906円)より分配対象額は416,900,948円(1万口当たり929.28円)であり、うち20,188,205円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年9月9日 至平成27年11月9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(15,639,270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(19,101,823円)及び分配準備積立金(326,202,631円)より分配対象額は360,943,724円(1万口当たり877.25円)であり、うち18,515,227円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期
	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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、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
	平成27年11月9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 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

	前 期	当 期
	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在



種 類	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	10,206,687	140,241,269
合計	10,206,687	140,241,269

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期 自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成27年5月8日現在	当 期 平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0355円 (10,355円)	0.9925円 (9,925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
親投資信託受益 証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファン ド	1,666,662,675	2,834,993,210	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	97,399,068	201,810,868	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	162,454,284	410,132,085	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	64,281,403	139,895,617	

	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	83,809,190	133,357,183	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	65,607,238	127,750,413	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	93,569,209	202,053,349	
親投資信託受益証券 合計			4,049,992,725	
合計			4,049,992,725	

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

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

### 「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,212,661,610	1,218,286,901
コール・ローン	424,771,813	176,794,592
国債証券	55,190,819,429	45,796,804,112
特殊債券	2,041,631,062	472,079,544
派生商品評価勘定	629,185,609	341,008,499
未収入金	1,329,597,898	1,952,344,355
未収利息	178,766,191	163,448,288
前払費用	252,206,778	147,284,487

差入委託証拠金	-	763,693,895
流動資産合計	62,259,640,390	51,031,744,673
資産合計	62,259,640,390	51,031,744,673
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,011,436,301	297,400,075
未払金	1,851,953,650	963,397,909
未払解約金	109,346,000	48,265,000
流動負債合計	2,972,735,951	1,309,062,984
負債合計	2,972,735,951	1,309,062,984
純資産の部		
元本等		
元本	1	33,878,402,267
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,408,502,172	20,490,846,563
元本等合計	59,286,904,439	49,722,681,689
純資産合計	59,286,904,439	49,722,681,689
負債純資産合計	62,259,640,390	51,031,744,673

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
-----------------------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	37,085,629,519円	33,878,402,267円
期中追加設定元本額	273,583,411円	70,016,285円
期中一部解約元本額	3,480,810,663円	4,716,583,426円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	2,965,415,584円	2,550,581,805円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型）	779,975,833円	771,179,034円

北海道応援・外債バランス ファンド(毎月分配型)	1,633,343,710円	-円
福島応援・外債バランスファ ンド(毎月分配型)	247,762,435円	-円
ダイワ外債ソブリン・オーブ ン(毎月分配型)	1,551,868,834円	1,432,007,178円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	69,974,578円	67,877,831円
新潟県応援ファンド(外債バ ランス・毎月分配型)	339,435,529円	-円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	289,431,470円	271,161,698円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	619,380,660円	562,478,936円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	810,783,251円	756,582,519円
F I T ネット・三県応援ファ ンド(毎月分配型)	331,241,105円	298,403,892円
長野応援ファンド(毎月分配 型)	461,780,311円	426,934,250円
栃木応援・外債バランスファ ンド(毎月分配型)	296,187,720円	259,289,456円
京都応援バランスファンド (隔月分配型)	336,148,563円	311,538,359円
北東北三県応援・外債バラ ンスファンド(毎月分配型)	273,704,145円	248,897,751円
6資産バランスファンド(分 配型)	1,788,796,063円	1,681,667,042円
6資産バランスファンド(成 長型)	167,836,673円	159,462,497円
ダイワ海外ソブリン・ファン ド(毎月分配型)	15,334,714,492円	14,427,440,332円
富山応援ファンドP A R T 2 (地域企業株・外債バラ ンス/隔月分配型)	425,442,558円	419,794,083円
奈良応援ファンド(外債バラ ンス・毎月分配型)	136,125,584円	134,378,440円
ダイワ三資産分散ファンド (インカム&キャッシュ、外 債、内外リート)(隔月分配 型)	366,577,847円	354,301,737円

世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	129,254,094円	111,423,840円
ダイワ外債ソブリン・ファン ド（毎月分配型）	1,589,837,795円	1,447,770,724円
兵庫応援バランスファンド （毎月分配型）	125,117,815円	117,678,237円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン（奇数月分 配型）	39,766,955円	33,407,695円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	413,976,224円	378,214,775円
紀陽地域株式・外債バラン スファンド（隔月分配型）	213,116,879円	82,634,626円
愛媛県応援ファンド（外債バ ランス・毎月分配型）	103,661,476円	84,984,008円
ダイワ資産分散インカムオー プン（奇数月決算型）	1,847,419,177円	1,666,662,675円
地球環境株・外債バラン ス・ファンド	116,949,486円	108,003,876円
ダイワ海外ソブリン・ファン ド（1年決算型）	73,375,421円	67,077,830円
計	33,878,402,267円	29,231,835,126円
2. 期末日における受益権の総数	33,878,402,267口	29,231,835,126口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月9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	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
--	-------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	2,055,031,555	659,544,413
特殊債券	44,649,769	3,233,136
合計	2,099,681,324	662,777,549

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成27年4月11日から平成27年5月8日まで、及び平成27年10月14日から平成27年11月9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

### 1. 債券関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
売 建	-	-	-	-	8,010,021,313	-	7,966,690,614	43,330,699
買 建	-	-	-	-	5,377,857,375	-	5,379,013,529	1,156,154
合計	-	-	-	-	13,387,878,688	-	13,345,704,143	44,486,853

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
- 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。

### 2. 通貨関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち			(円)	うち		



		1年超				1年超		
市場取引以外 の取引								
為替予約取引								
売 建	33,860,537,155	-	34,859,502,633	998,965,478	28,818,123,955	-	28,783,318,323	34,805,632
アメリカ・ドル	8,096,465,471	-	8,136,050,237	39,584,766	2,845,670,920	-	2,908,948,942	63,278,022
イギリス・ ポンド	3,150,941,972	-	3,265,707,296	114,765,324	3,861,031,349	-	3,874,073,988	13,042,639
オーストラリ ア・ドル	5,487,244,991	-	5,625,328,181	138,083,190	2,496,075,137	-	2,509,743,552	13,668,415
カナダ・ドル	7,078,115,615	-	7,248,365,153	170,249,538	4,397,704,668	-	4,423,765,544	26,060,876
スウェーデン・ クローナ	2,533,688,884	-	2,662,716,816	129,027,932	1,147,520,000	-	1,145,340,000	2,180,000
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	883,658,455	-	879,946,264	3,712,191
ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	625,400,000	-	626,560,000	1,160,000
ポーランド・ ズロチ	-	-	-	-	1,116,200,000	-	1,084,650,000	31,550,000
ユーロ	7,514,080,222	-	7,921,334,950	407,254,728	11,444,863,426	-	11,330,290,033	114,573,393
買 建	33,860,537,155	-	34,477,251,941	616,714,786	28,535,692,505	-	28,500,008,444	35,684,061
アメリカ・ドル	8,554,541,637	-	8,566,200,971	11,659,334	3,324,614,871	-	3,391,799,818	67,184,947
イギリス・ ポンド	1,619,251,281	-	1,658,227,718	38,976,437	3,406,162,251	-	3,404,249,654	1,912,597
オーストラリ ア・ドル	7,118,778,918	-	7,254,473,095	135,694,177	3,186,823,087	-	3,174,935,346	11,887,741
カナダ・ドル	10,385,497,768	-	10,618,071,861	232,574,093	6,745,290,506	-	6,780,196,391	34,905,885
スウェーデン・ クローナ	1,011,751,724	-	1,030,420,395	18,668,671	1,318,646,601	-	1,313,799,019	4,847,582
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	906,410,000	-	886,045,498	20,364,502
ノルウェー・ クローネ	396,160,000	-	400,512,191	4,352,191	579,869,283	-	569,600,000	10,269,283
ポーランド・ ズロチ	2,779,782,174	-	2,897,805,215	118,023,041	2,699,221,265	-	2,674,358,313	24,862,952
ユーロ	1,994,773,653	-	2,051,540,495	56,766,842	6,368,654,641	-	6,305,024,405	63,630,236

合計	67,721,074,310	-	69,336,754,574	382,250,692	57,353,816,460	-	57,283,326,767	878,429
----	----------------	---	----------------	-------------	----------------	---	----------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.7500円	1.7010円
(1万口当たり純資産額)	(17,500円)	(17,010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	0.25% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20250115	アメリカ・ドル 12,500,000.000	アメリカ・ドル 11,956,371.980	
		0.125% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20200415	4,000,000.000	4,013,440.760	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	14,000,000.000	13,936,440.000	

	2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	25,000,000.000	24,572,250.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	5,000,000.000	4,975,000.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20250815	28,000,000.000	27,192,760.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	13,000,000.000	12,455,560.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 99,101,822.740 (12,220,245,762)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	12,000,000.000	15,146,400.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	8,400,000.000	11,164,440.000	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	13,500,000.000	14,376,150.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 40,686,990.000 (7,556,794,652)	
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	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	5,000,000.000	5,888,500.000	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	5,000,000.000	5,382,650.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	32,500,000.000	33,741,825.000	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	5,700,000.000	6,414,951.000	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 51,427,926.000 (4,463,429,697)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	5,000,000.000	5,562,500.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	10,000,000.000	10,887,600.000	

	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	5,000,000.000	6,150,000.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	12,000,000.000	12,561,000.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	4,500,000.000	4,345,740.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 39,506,840.000 (3,659,913,658)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	8,700,000.000	10,824,192.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	45,500,000.000	52,355,030.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 63,179,222.000 (893,354,199)	
デンマーク・ク ローネ	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	15,000,000.000	17,411,550.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	23,000,000.000	24,677,620.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 42,089,170.000 (746,661,876)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,155,080.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 4,155,080.000 (59,209,890)	
ポーランド・ズ ロチ	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	20,000,000.000	22,586,000.000	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	14,000,000.000	15,168,300.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ	

				37,754,300.000 (1,170,383,300)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	42,000,000.000	41,362,860.000	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	20,000,000.000	22,443,800.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,000,000.000	3,838,170.000	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	3,500,000.000	3,947,300.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	12,000,000.000	11,334,000.000	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,500,000.000	2,213,340.000	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	14,300,000.000	17,636,333.000	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	5,000,000.000	5,926,350.000	
		2.125% Lithuania Government International Bond 20261029	2,000,000.000	2,147,280.000	
		3.375% Lithuania Government International Bond 20240122	600,000.000	710,196.000	
		1.25% Lithuania Government International Bond 20251022	2,000,000.000	1,978,800.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 113,538,429.000 (15,026,811,078)	
国債証券	合計			45,796,804,112 [45,796,804,112]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.3% Japan Bank For International Cooperation 20180319	カナダ・ドル 5,000,000.000	カナダ・ドル 5,095,850.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 5,095,850.000 (472,079,544)	
特殊債券	合計			472,079,544 [472,079,544]	
合計				46,268,883,656 [46,268,883,656]	

- (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 7銘柄	100%	26.4%
イギリス・ポンド	国債証券 3銘柄	100%	16.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 4銘柄	100%	9.6%
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄 特殊債券 1銘柄	100%	8.9%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	1.9%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	1.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	2.5%
ユーロ	国債証券 11銘柄	100%	32.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ・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

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,297,169,772	2,353,995,434
コール・ローン	1,249,852,743	964,498,844
投資証券	165,469,264,644	154,126,169,298
派生商品評価勘定	2,029,745	5,750,511
未収入金	6,745,431,815	816,840,093
未収配当金	468,964,867	225,632,132
流動資産合計	175,232,713,586	158,492,886,312
資産合計	175,232,713,586	158,492,886,312

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	180,272	-
未払金	5,764,343,197	95,282,852
未払解約金	110,681,000	250,005,000
流動負債合計	5,875,204,469	345,287,852
負債合計	5,875,204,469	345,287,852
純資産の部		
元本等		
元本	1	85,194,524,260
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	84,162,984,857	81,821,908,265
元本等合計	169,357,509,117	158,147,598,460
純資産合計	169,357,509,117	158,147,598,460
負債純資産合計	175,232,713,586	158,492,886,312

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	94,469,357,818円	85,194,524,260円
期中追加設定元本額	325,351,283円	274,421,925円
期中一部解約元本額	9,600,184,841円	9,143,255,990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）	77,681,220,410円	69,756,837,197円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	60,122,890円	58,300,253円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	35,569,653円	31,243,179円



インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	38,197,224円	32,443,433円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	176,019,428円	155,665,782円
6資産バランスファンド(分 配型)	309,710,451円	276,746,519円
6資産バランスファンド(成 長型)	588,043,629円	559,445,703円
ダイワ三資産分散ファンド (インカム&キャッシュ、外 債、内外リート)(隔月分配 型)	31,121,979円	28,681,835円
りそな ワールド・リート・ ファンド	3,442,270,305円	2,959,362,402円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	112,778,329円	92,317,550円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	8,454,488円	7,366,169円
常陽3分法ファンド	519,119,487円	423,956,051円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	113,940,593円	97,399,068円
ダイワ・海外株式&REIT ファンド(毎月分配型)	35,518,328円	33,292,034円
スマート・インカム・ balan ス	167,563円	- 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	168,495,784円	178,048,412円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	229,012,732円	231,267,176円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	242,206,648円	282,897,698円
ダイワ・グローバルREIT ファンド(ダイワSMA専 用)	416,485,084円	225,242,395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)	932,256,397円	837,614,314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)	21,964,568円	23,177,147円

ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（為替ヘッジなし）	31,848,290円	34,385,878円
計	85,194,524,260円	76,325,690,195円
2. 期末日における受益権の総数	85,194,524,260口	76,325,690,195口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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	平成27年11月9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。

	<p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	---

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9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	5,906,397,543	9,372,921,411
合計	5,906,397,543	9,372,921,411

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年3月17日から平成27年5月8日まで、及び平成27年9月16日から平成27年11月9日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	509,489,227	-	509,394,283	94,944	676,687,760	-	675,700,127	987,633
アメリカ・ドル	-	-	-	-	308,263,750	-	308,250,000	13,750
オーストラリア・ドル	4,121,882	-	4,104,952	16,930	368,424,010	-	367,450,127	973,883
シンガポール・ドル	505,367,345	-	505,289,331	78,014	-	-	-	-
買 建	509,489,227	-	511,243,756	1,754,529	368,424,010	-	373,186,888	4,762,878

アメリカ・ドル	509,489,227	-	511,243,756	1,754,529	368,424,010	-	373,186,888	4,762,878
合計	1,018,978,454	-	1,020,638,039	1,849,473	1,045,111,770	-	1,048,887,015	5,750,511

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.9879円	2.0720円
(1万口当たり純資産額)	(19,879円)	(20,720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	SIMON PROPERTY	486,157	94,751,999.300	
		BIOMED REALTY TR	107,410	2,500,504.800	
		APARTMENT INVEST	954,954	35,419,243.860	
		VORNADO RLTY TST	388,714	37,503,126.720	
		QTS REALTY TRU-A	219,654	9,370,439.640	

	EQUITY RESIDENTI	760,020	58,445,538.000	
	EQUINIX INC	45,618	13,246,098.660	
	HOST HOTELS & RE	1,327,005	23,196,047.400	
	PHYSICIANS REALT	615,023	9,612,809.490	
	CYRUSONE INC	276,123	9,584,229.330	
	PARAMOUNT GROUP	1,196	21,683.480	
	SPIRIT REALTY	953,161	9,302,851.360	
	SUN COMMUNITIES	242,968	15,489,210.000	
	DDR CORP	1,692,407	27,840,095.150	
	FED REALTY INVS	117,971	17,003,160.230	
	WELLTOWER INC	403,407	24,615,895.140	
	KILROY REALTY	287,052	18,233,543.040	
	MID-AMERICA APAR	187,253	15,600,047.430	
	EQUITY LIFESTYLE	214,098	12,554,706.720	
	PENN REIT	632,715	13,919,730.000	
	PS BUSINESS PARK	78,892	6,705,820.000	
	REGENCY CENTERS	288,232	19,023,312.000	
	RAMCO-GERSHENSON	557,199	9,327,511.260	
	SL GREEN REALTY	254,282	29,557,739.680	
	OMEGA HEALTHCARE	562,469	18,291,491.880	
	CUBESMART	722,694	19,635,595.980	
	SUNSTONE HOTEL	329,286	4,814,161.320	
	EXTRA SPACE STOR	537,686	41,676,041.860	
	EDUCATION REALTY	388,131	13,724,312.160	
	DIAMONDROCK HOSP	1,213,838	14,092,659.180	
	DCT INDUSTRIAL T	246,260	9,114,082.600	
	RETAIL PROPERTIE	937,271	13,740,392.860	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 647,914,080.530 (79,894,285,270)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	11,423,675	6,568,613.120	
	CAP & REGIONAL	6,130,935	4,230,345.150	
	LAND SECURITIES	3,139,450	41,064,006.000	
	HAMMERSON PLC	4,080,106	25,113,052.430	
	DERWENT LONDON	347,534	13,060,327.720	
	BIG YELLOW GROUP	1,689,619	12,427,147.740	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 102,463,492.160	

			(19,030,544,400)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	NATIONAL STORAGE	6,654,587	10,580,793.330
	SCENTRE GROUP	13,680,194	55,951,993.460
	WESTFIELD CORP	7,880,884	80,779,061.000
	GOODMAN GROUP	1,830,139	11,255,354.850
	VICINITY CENTERS	21,959,491	64,341,308.630
	INGENIA COMMUNIT	34,250,764	15,412,843.800
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 238,321,355.070 (20,683,910,407)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ALLIED PROP REIT	241,654	7,926,251.200
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 7,926,251.200 (734,287,911)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	20,389,571	21,409,049.550
	CAPITALAND MALL	7,758,000	15,244,470.000
	FRASERS CENTREPO	7,618,900	14,704,477.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 51,357,996.550 (4,450,683,981)
ユーロ			ユーロ
	ALSTRIA OFFICE	995,916	12,155,154.780
	WERELDHAVE NV	394,012	21,343,630.040
	NSI NV	2,552,342	9,951,581.450
	KLEPIERRE	1,630,731	68,759,772.610
	FONCIERE DES REG	250,949	20,969,298.440
	WAREHOUSES DE PA	83,943	6,399,814.320
	BENI STABILI SPA	19,271,730	13,991,275.980
	LAR ESPANA REAL	1,192,956	11,574,059.110
	MERLIN PROPERTIE	519,966	5,979,609.000
ユーロ 小計			ユーロ 171,124,195.730 (22,648,287,305)
香港・ドル			香港・ドル
	FORTUNE REIT	15,935,070	126,683,806.500

	LINK REIT	5,046,920	234,681,780.000	
	CHAMPION REIT	14,763,376	58,758,236.480	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 420,123,822.980 (6,684,170,024)	
投資証券	合計		154,126,169,298 [154,126,169,298]	
合計			154,126,169,298 [154,126,169,298]	

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 32銘柄	100%	51.9%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	100%	12.3%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	13.4%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.5%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	100%	2.9%
ユーロ	投資証券 9銘柄	100%	14.7%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	100%	4.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	2,196,374,998	1,191,991,101
投資証券	66,913,728,000	72,239,115,600
未収入金	4,342,306	62,064,122
未収配当金	473,665,400	615,535,836
流動資産合計	69,588,110,704	74,108,706,659
資産合計	69,588,110,704	74,108,706,659
負債の部		
流動負債		
未払金	789,094,654	271,624,962
未払解約金	9,474,000	10,943,000
流動負債合計	798,568,654	282,567,962
負債合計	798,568,654	282,567,962
純資産の部		
元本等		
元本	1 30,330,841,984	34,188,962,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	38,458,700,066	39,637,176,367
元本等合計	68,789,542,050	73,826,138,697
純資産合計	68,789,542,050	73,826,138,697
負債純資産合計	69,588,110,704	74,108,706,659

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
----------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	23,315,529,699円	30,330,841,984円
期中追加設定元本額	8,153,637,514円	5,479,458,061円
期中一部解約元本額	1,138,325,229円	1,621,337,715円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	31,346,216円	29,980,743円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	33,438,907円	31,284,848円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	153,707,093円	149,909,485円
6資産バランスファンド（分配型）	272,222,635円	265,707,623円
6資産バランスファンド（成長型）	518,036,032円	535,744,125円
ダイワ三資産分散ファンド（インカム&キャッシュ、外債、内外リート）（隔月分配型）	27,888,605円	27,888,605円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	98,678,242円	89,010,489円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	3,726,909円	3,360,756円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	99,978,115円	93,569,209円
成果リレー（ブラジル国債&J-REIT）2014-07	211,632,897円	189,659,371円
成果リレー（ブラジル国債&J-REIT）2014-08	154,530,866円	144,108,589円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	148,245,119円	168,337,856円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	200,987,593円	223,520,278円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	211,991,519円	269,940,044円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	372,517,177円	373,780,531円
ダイワファンドラップ J-REIT セレクト	26,652,636,547円	30,521,978,607円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	210,996,407円	192,047,048円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	57,445,086円	54,072,852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）	340,747,375円	336,536,562円
ダイワJリート・ファンド	530,088,644円	488,524,709円
計	30,330,841,984円	34,188,962,330円
2. 期末日における受益権の総数	30,330,841,984口	34,188,962,330口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月9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 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9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	4,010,985,706	4,737,808,315
合計	4,010,985,706	4,737,808,315

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成26年11月11日から平成27年5月8日まで、及び平成27年5月12日から平成27年11月9日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.2680円	2.1594円
（1万口当たり純資産額）	（22,680円）	（21,594円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,000	1,249,500,000	
	MCUBS MidCity投資法人	5,000	1,725,000,000	
	森ヒルズリート	10,000	1,485,000,000	
	産業ファンド	3,000	1,635,000,000	
	大和ハウズリート	2,000	966,000,000	
	アドバンス・レジデンス	8,000	2,088,000,000	
	ケネディクスレジデンシャル	3,500	1,045,100,000	
	API投資法人	4,600	2,304,600,000	
	GLP投資法人	20,000	2,390,000,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	3,000	677,100,000	
	日本プロロジスリート	9,000	1,996,200,000	
	星野リゾート・リート	605	726,000,000	
	SIA不動産投資	100	46,450,000	
	イオンリート投資	4,000	568,800,000	
	ヒューリックリート投資法	5,000	790,000,000	
	日本リート投資法人	4,000	1,146,800,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	20,000	1,950,000,000	
	積水ハウス・リート投資	9,000	1,125,000,000	
	トーセイ・リート投資法人	4,500	515,250,000	
	ケネディクス商業リート	4,200	973,140,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	3,000	333,600,000	
	サムティ・レジデンシャル	1,000	86,100,000	
	ジャパン・シニアリビング	868	131,675,600	
	野村不動産マスターF	31,000	4,739,900,000	
	日本ビルファンド	6,600	3,696,000,000	
	ジャパンリアルエステイト	8,800	4,796,000,000	
	日本リテールファンド	17,000	3,893,000,000	
オリックス不動産投資	14,000	2,244,200,000		
日本プライムリアルティ	6,000	2,355,000,000		

プレミア投資法人	9,500	1,099,150,000	
東急リアル・エステート	2,000	291,800,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,000	1,197,000,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,000	2,640,000,000	
森トラスト総合リート	7,000	1,477,000,000	
インヴィンシブル投資法人	34,000	2,366,400,000	
フロンティア不動産投資	2,000	969,000,000	
平和不動産リート	1,000	89,500,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,000	1,592,500,000	
福岡リート投資法人	3,000	580,200,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,000	1,611,000,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,500	276,500,000	
いちごオフィスリート投資法人	13,000	1,080,300,000	
大和証券オフィス投資法人	3,200	1,952,000,000	
阪急リート投資法人	1,500	193,950,000	
トップリート投資法人	2,800	1,279,600,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	2,000	490,400,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,000	2,793,600,000	
日本賃貸住宅投資法人	24,000	1,924,800,000	
ジャパンエクセレント投資法人	5,000	656,000,000	
投資証券 合計		72,239,115,600	
合計		72,239,115,600	

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。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		49,185,116	14,097,427
コール・ローン		40,681,429	21,891,100
株式		1,620,871,694	1,551,174,941
ハイブリッド優先証券		498,962,717	507,049,725
投資証券		47,782,134	46,865,070
派生商品評価勘定		-	35,086
未収入金		15,463,302	34,970,406
未収配当金		2,414,271	2,486,193
未収利息		1,059,082	949,301
流動資産合計		2,276,419,745	2,179,519,249
資産合計		2,276,419,745	2,179,519,249
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	4,200
未払金		19,609,573	15,264,588
未払解約金		1,889,000	7,223,000
流動負債合計		21,498,573	22,491,788
負債合計		21,498,573	22,491,788
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,084,702,040	991,148,092
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,170,219,132	1,165,879,369
元本等合計		2,254,921,172	2,157,027,461
純資産合計		2,254,921,172	2,157,027,461
負債純資産合計		2,276,419,745	2,179,519,249

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

### (2)ハイブリッド優先証券

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。

### (3)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

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。

3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	1,218,015,036円	1,084,702,040円
期中追加設定元本額	45,071,385円	71,379,612円
期中一部解約元本額	178,384,381円	164,933,560円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株 ファンド(毎月分配型)	79,021,792円	- 円
安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	23,015,417円	20,706,336円
インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	24,628,371円	21,406,883円
成長重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	398,761,514円	359,398,946円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	65,077,013円	56,694,671円



ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	73,610,034円	64,281,403円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	73,544,185円	78,731,337円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	149,725,468円	155,064,044円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	197,318,246円	234,864,472円
計	1,084,702,040円	991,148,092円
2. 期末日における受益権の総数	1,084,702,040口	991,148,092口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月9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 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	15,819,355	75,988,431
ハイブリッド優先証券	11,266,547	3,766,652
投資証券	426,072	444,992
合計	27,511,974	80,200,075

## （注）

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年4月16日から平成27年5月8日まで、及び平成27年10月16日から平成27年11月9日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の 取引  為替予約取引								

売 建	-	-	-	-	2,774,700	-	2,778,900	4,200
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,774,700	-	2,778,900	4,200
買 建	-	-	-	-	2,774,700	-	2,809,786	35,086
アメリカ・ドル	-	-	-	-	2,774,700	-	2,809,786	35,086
合計	-	-	-	-	5,549,400	-	5,588,686	30,886

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.0788円	2.1763円
(1万口当たり純資産額)	(20,788円)	(21,763円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	CF INDUSTRIES HO	1,500	46.520	69,780.000	
	AETNA INC	3,000	107.550	322,650.000	

HONEYWELL INTL	1,500	104.000	156,000.000	
DEVON ENERGY CO	1,100	46.870	51,557.000	
ALLIANT ENERGY	2,700	56.990	153,873.000	
TE CONNECTIVITY	4,800	66.550	319,440.000	
APPLE INC	4,200	121.060	508,452.000	
DISCOVER FINANCI	4,500	57.610	259,245.000	
JPMORGAN CHASE	4,700	68.460	321,762.000	
AMERIPRISE FINAN	2,200	119.280	262,416.000	
CMS ENERGY CORP	3,700	34.240	126,688.000	
AVAGO TECHNOLOGI	1,800	129.670	233,406.000	
TIME WARNER INC	1,400	68.860	96,404.000	
EAST WEST BNCRP	2,300	43.490	100,027.000	
LYONDELLBASELL-A	1,500	96.180	144,270.000	
HANESBRANDS INC	7,700	32.800	252,560.000	
EXPEDIA INC	500	133.320	66,660.000	
EXXON MOBIL CORP	5,734	84.470	484,350.980	
L-3 COMM HLDGS	750	122.090	91,567.500	
FORD MOTOR CO	12,900	14.520	187,308.000	
NEXTERA ENERGY	2,462	98.840	243,344.080	
GENERAL ELECTRIC	4,300	29.920	128,656.000	
GENERAL DYNAMICS	1,300	145.920	189,696.000	
MGIC INVT CORP	10,000	9.610	96,100.000	
HALLIBURTON CO	700	39.350	27,545.000	
HOME DEPOT INC	2,000	125.980	251,960.000	
ASSURANT INC	1,100	84.900	93,390.000	
HUNTINGTON BANC	14,500	11.650	168,925.000	
JOHNSON&JOHNSON	1,000	101.920	101,920.000	
ABBVIE INC	3,500	64.130	224,455.000	
KROGER CO	4,700	37.570	176,579.000	
MONSANTO CO	1,600	93.490	149,584.000	
MERCK & CO	4,300	54.610	234,823.000	
NETAPP INC	2,900	34.400	99,760.000	
OCCIDENTAL PETE	2,600	75.100	195,260.000	
PROCTER & GAMBLE	2,600	75.570	196,482.000	
ACCENTURE PLC-A	3,000	106.000	318,000.000	
QUALCOMM INC	2,700	53.420	144,234.000	
REPUBLIC SVCS	4,300	44.070	189,501.000	
ROSS STORES INC	4,000	50.400	201,600.000	
CHEVRON CORP	1,200	94.030	112,836.000	

SYSCO CORP	2,200	40.930	90,046.000	
AT&T INC	8,900	33.160	295,124.000	
MARATHON PETROLE	1,100	55.970	61,567.000	
UNITED PARCEL-B	1,700	104.990	178,483.000	
ANTHEM INC	800	133.980	107,184.000	
WALT DISNEY CO	2,200	115.670	254,474.000	
WELLS FARGO & CO	5,226	55.850	291,872.100	
WAL-MART STORES	1,100	58.780	64,658.000	
VISA INC-CLASS A	3,600	78.750	283,500.000	
PNC FINANCIAL SE	1,700	95.200	161,840.000	
TYSON FOODS-A	2,900	45.500	131,950.000	
THERMO FISHER	1,194	134.300	160,354.200	
ANALOG DEVICES	3,100	61.700	191,270.000	
EQUIFAX INC	1,400	106.060	148,484.000	
GILEAD SCIENCES	1,400	108.340	151,676.000	
CARDINAL HEALTH	2,900	88.500	256,650.000	
HARTFORD FINL SV	3,700	47.600	176,120.000	
WW GRAINGER INC	400	212.190	84,876.000	
MICROSOFT CORP	7,100	54.920	389,932.000	
CVS HEALTH CORP	3,475	98.700	342,982.500	
MEDTRONIC PLC	2,616	76.060	198,972.960	
BLACKROCK INC	700	356.700	249,690.000	
ACE LTD	1,700	113.030	192,151.000	
XILINX INC	700	47.630	33,341.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 12,250,264.320 (1,510,580,093)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
SUNCOR ENERGY	5,300	39.470	209,191.000	
POTASH CORP SAS	3,000	27.170	81,510.000	
MAGNA INTL	2,300	64.130	147,499.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 438,200.000 (40,594,848)	
合計			1,551,174,941 [1,551,174,941]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	

JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	3,200.000	81,248.000	
CHS INC 7.5 4	3,475.000	96,292.250	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 6.25	1,350.000	35,748.000	
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4,000.000	101,320.000	
WINTRUST FINANCIAL CORP 6.5 D	3,700.000	97,162.000	
FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B	6,225.000	166,207.500	
VALLEY NATIONAL BANCORP 6.25 A	4,400.000	115,720.000	
FIRST REPUBLIC BANK 5.7 F	5,225.000	129,893.500	
CHARLES SCHWAB CORP 6 C	1,300.000	33,631.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,650.000	42,669.000	
SCE TRUST IV 5.375 J	1,000.000	25,980.000	
WELLS FARGO & COMPANY 6 V	1,750.000	45,307.500	
QWEST CORP 6.625	2,075.000	52,041.000	
SOUTHERN CO 6.25	4,100.000	105,206.000	
SEASPAN CORPORATION 9.5 C	5,118.000	129,383.040	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.625 H	1,200.000	30,816.000	
BB&T CORPORATION 5.2 G	1,071.000	26,775.000	
DTE ENERGY COMPANY 5.25	3,000.000	74,370.000	
ZIONS BANCORPORATION 5.75 H	2,100.000	51,954.000	
ASPEN INSURANCE HLDG LTD 7.25	700.000	18,676.000	
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	3,200.000	83,712.000	
AMTRUST FINANCIAL SERVIC 6.75 A	1,500.000	35,850.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.5	3,321.000	82,526.850	
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	53,844.000	
ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.95	900.000	22,950.000	
PARTNERRE LTD 7.25 E	3,500.000	100,030.000	
COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75	5,050.000	129,381.000	
PARTNERRE LTD 6.5 D	1,818.000	49,358.700	
PRIVATEBANCORP INC 7.125	1,513.000	40,941.780	
WELLS FARGO & COMPANY 8 J	5,025.000	141,051.750	
CITIGROUP CAPITAL XIII 6.6919	7,491.000	190,720.860	
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	2,100.000	58,968.000	
MORGAN STANLEY 6.875 F	2,004.000	54,328.440	
ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40	7,325.000	189,424.500	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	2,471.000	65,184.980	
US BANCORP 6.5 F	3,452.000	99,728.280	
WELLS FARGO & COMPANY 6.625	2,441.000	68,567.690	
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	2,308.000	64,070.080	
BANK OF AMERICA CORP 6.625 W	1,970.000	52,145.900	

		ALLSTATE CORP 6.625 E	628.000	17,081.600	
		QWEST CORP 7	1,300.000	34,346.000	
		ALLSTATE CORP 5.1	1,100.000	28,248.000	
		MORGAN STANLEY 6.625 G	1,500.000	40,275.000	
		MORGAN STANLEY 7.125 E	1,737.000	48,514.410	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	5,900.000	153,341.000	
		REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	500.000	14,355.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 5.5 O	775.000	19,258.750	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85	1,700.000	43,860.000	
		CITIGROUP INC 7.125 J	4,213.000	115,394.070	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.7 T	3,200.000	86,112.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	700.000	18,186.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	1,600.000	43,296.000	
		HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875	3,325.000	102,011.000	
		PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B	6,150.000	155,410.500	
		ASTORIA FINANCIAL CORP 6.5 C	5,800.000	149,118.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 4,111,991.930 (507,049,725)	
ハイブリッド優先証券		合計		507,049,725 [507,049,725]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		NORTHSTAR REALTY FIN 8.875 C	1,500	36,390.000	
		RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A	2,000	50,780.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC 7.25 B	662	16,702.260	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 B	1,700	43,384.000	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES 7.125 C	3,200	80,544.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A	1,110	28,893.300	
		VEREIT INC 6.7 F	2,826	70,367.400	
		VORNADO REALTY TRUST 5.4 L	2,200	52,998.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 380,058.960 (46,865,070)	
投資証券		合計		46,865,070 [46,865,070]	
合計				553,914,795 [553,914,795]	

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

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における ( ) 内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における [ ] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 ハイブリッド 優先証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額 に 対する比 率
アメリカ・ドル	株式	65銘柄			
	ハイブリッド優先証券	55銘柄	73.1%	24.6%	98.1%
	投資証券	8銘柄			
カナダ・ドル	株式	3銘柄	100%	-%	1.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	15,262,372	67,646,003
コール・ローン	30,288,757	38,541,391
株式	1,709,673,667	1,405,666,627
未収配当金	7,452,880	1,399,288
流動資産合計	1,762,677,676	1,513,253,309
資産合計	1,762,677,676	1,513,253,309
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,945,000	1,810,000
流動負債合計	4,945,000	1,810,000
負債合計	4,945,000	1,810,000



純資産の部		
元本等		
元本	1	1,061,331,528
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		696,401,148
元本等合計		1,757,732,676
純資産合計		1,757,732,676
負債純資産合計		1,762,677,676
		949,861,635
		561,581,674
		1,511,443,309
		1,511,443,309
		1,513,253,309

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	1,259,700,102円	1,061,331,528円
期中追加設定元本額	26,525,254円	53,026,340円
期中一部解約元本額	224,893,828円	164,496,233円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株 ファンド(毎月分配型)	100,474,502円	- 円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	29,139,338円	26,193,797円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	31,189,842円	29,009,259円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	506,866,352円	479,323,313円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	81,571,656円	76,252,353円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	93,254,392円	83,809,190円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	38,284,102円	42,986,493円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	77,847,592円	84,090,975円

DCダイワ・ワールドアセット ト(六つの羽/成長コース)	102,703,752円	128,196,255円
計	1,061,331,528円	949,861,635円
2. 期末日における受益権の総数	1,061,331,528口	949,861,635口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月9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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	95,734,145	77,871,955
合計	95,734,145	77,871,955

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年4月16日から平成27年5月8日まで、及び平成27年10月16日から平成27年11月9日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.6562円	1.5912円
（1万口当たり純資産額）	（16,562円）	（15,912円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	REXAM PLC	29,192	5.495	160,410.040	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	15.450	229,339.800	
	AVIVA PLC	40,669	4.871	198,098.690	
	GLAXOSMITHKLINE	15,900	13.845	220,135.500	
	VODAFONE GROUP	90,005	2.162	194,590.810	
	KINGFISHER PLC	44,504	3.537	157,410.640	
	RECKITT BENCKISE	3,420	62.670	214,331.400	

	NATIONAL GRID PL	22,159	8.942	198,145.770	
	BRIT AMER TOBACC	7,264	38.100	276,758.400	
	HSBC HLDGS PLC	52,046	5.278	274,698.780	
	ROYAL DUTCH SH-A	9,924	17.120	169,898.880	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 2,293,818.710 (426,030,949)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	NESTLE SA-REG	7,685	75.450	579,833.250	
	ZURICH INSURANCE	1,005	263.100	264,415.500	
	NOVARTIS AG-REG	5,611	89.900	504,428.900	
	GIVAUDAN-REG	138	1,830.000	252,540.000	
	LAFARGEHOLCIM-RE	2,547	57.700	146,961.900	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 1,748,179.550 (214,309,332)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クロー ナ	
	SWEDBANK AB-A	12,350	196.100	2,421,835.000	
	HENNES & MAURI-B	6,378	335.100	2,137,267.800	
	SVENSKA CELL-B	10,734	250.000	2,683,500.000	
	ATLAS COPCO-B	10,292	212.600	2,188,079.200	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クロー ナ 9,430,682.000 (133,349,843)	
デンマーク・ク ローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	TDC A/S	40,420	38.840	1,569,912.800	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 1,569,912.800 (27,850,253)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB ASA	14,281	113.700	1,623,749.700	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 1,623,749.700 (23,138,433)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	2,789	123.450	344,302.050	
	SIEMENS AG-REG	2,489	94.080	234,165.120	

BAYER MOTOREN WK	2,083	96.030	200,030.490	
BASF SE	3,829	77.130	295,330.770	
ALLIANZ SE-VINK	1,541	157.300	242,399.300	
DEUTSCHE TELEKOM	21,145	16.780	354,813.100	
KONINKLIJKE PHIL	10,209	25.275	258,032.470	
AHOLD NV	11,875	19.170	227,643.750	
DSM (KONIN)	4,772	49.765	237,478.580	
TOTAL SA	5,636	46.235	260,580.460	
SCHNEIDER ELECTR	4,676	58.150	271,909.400	
BNP PARIBAS	5,987	57.610	344,911.070	
SANOFI	4,064	86.900	353,161.600	
ENI SPA	10,824	14.900	161,277.600	
ENAGAS SA	10,115	27.370	276,847.550	
OESTERREICH.POST	3,818	33.710	128,704.780	
CTT-CORREIOS DE	20,773	9.541	198,195.190	
ユーロ 小計			ユーロ 4,389,783.280 (580,987,817)	
合計			1,405,666,627 [1,405,666,627]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 11銘柄	100%	30.3%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	15.2%
スウェーデン・クローナ	株式 4銘柄	100%	9.5%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	2.0%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.6%
ユーロ	株式 17銘柄	100%	41.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,789,370	65,114,515
コール・ローン	70,981,788	46,577,607
株式	1,312,625,025	1,011,854,289
投資証券	49,942,023	-
未収入金	50,225,161	26,486,696
未収配当金	1,731,923	927,959
流動資産合計	1,508,295,290	1,150,961,066
資産合計	1,508,295,290	1,150,961,066
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	36,984
未払金	-	22,180,181
未払解約金	57,187,000	6,000
流動負債合計	57,187,000	22,223,165
負債合計	57,187,000	22,223,165
純資産の部		
元本等		
元本	1 661,223,279	579,670,768
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	789,885,011	549,067,133
元本等合計	1,451,108,290	1,128,737,901
純資産合計	1,451,108,290	1,128,737,901
負債純資産合計	1,508,295,290	1,150,961,066

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>



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。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	842,258,330円	661,223,279円
期中追加設定元本額	3,918,181円	13,270,915円
期中一部解約元本額	184,953,232円	94,823,426円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株 ファンド(毎月分配型)	75,625,728円	- 円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	21,651,466円	21,285,343円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	22,972,894円	23,354,664円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	380,271,526円	375,493,723円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	60,768,408円	59,880,269円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	69,633,781円	65,607,238円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	5,423,324円	5,714,908円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	10,792,362円	11,162,392円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	14,083,790円	17,172,231円
計	661,223,279円	579,670,768円

2. 期末日における受益権の総数	661,223,279口	579,670,768口
------------------	--------------	--------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9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	平成27年11月9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  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	6,896,342	8,579,762
投資証券	2,033,470	-
合計	8,929,812	8,579,762

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年4月16日から平成27年5月8日まで、及び平成27年10月16日から平成27年11月9日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	36,629,984	-	36,593,000	36,984
香港・ドル	-	-	-	-	36,629,984	-	36,593,000	36,984
合計	-	-	-	-	36,629,984	-	36,593,000	36,984

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1946円 (21,946円)	1.9472円 (19,472円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	12,500	22.700	283,750.000	
	SOUTH32 LTD	13,000	1.495	19,435.000	
	WOODSIDE PETRO	4,500	29.980	134,910.000	
	BENDIGO AND ADEL	13,000	10.760	139,880.000	
	NATL AUST BANK	10,800	28.650	309,420.000	
	WESTPAC BANKING	10,000	31.650	316,500.000	
	AMCOR LTD	68,000	13.610	925,480.000	
	COMMONW BK AUSTR	4,173	76.590	319,610.070	
	QANTAS AIRWAYS	46,950	3.710	174,184.500	
	CSL LTD	1,700	95.320	162,044.000	
	WESFARMERS LTD	8,000	39.130	313,040.000	
	COMPUTERSHARE LT	14,000	10.970	153,580.000	
SONIC HEALTHCARE	14,000	19.520	273,280.000		

	TRANSURBAN GROUP	30,000	10.390	311,700.000	
	DUET GROUP	60,315	2.390	144,152.850	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 3,980,966.420 (345,508,075)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	DBS GROUP HLDGS	17,000	17.400	295,800.000	
	SHENG SIONG GROU	500,000	0.840	420,000.000	
	INNOVALUES LTD	350,000	0.765	267,750.000	
	ROTARY ENGINEER	44,000	0.380	16,720.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 1,000,270.000 (86,683,398)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	MEDY-TOX INC	270	511,000.000	137,970,000.000	
	CROWN CONFECTION	520	600,000.000	312,000,000.000	
	COSMAX INC	700	190,000.000	133,000,000.000	
	CRUCIALTEC CO LT	30,743	14,950.000	459,607,850.000	
	SAMSUNG ELECTRON	470	1,338,000.000	628,860,000.000	
	CELLTRION INC	2,700	76,300.000	206,010,000.000	
	PARTRON CO LTD	18,000	9,690.000	174,420,000.000	
	ISC CO LTD	4,000	25,550.000	102,200,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 2,154,067,850.000 (230,485,261)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	GEELY AUTOMOBILE	300,000	4.000	1,200,000.000	
	BEST PACIFIC INT	150,000	3.200	480,000.000	
	AIA	30,000	47.800	1,434,000.000	
	NEXTEER	160,000	8.630	1,380,800.000	
	FIH MOBILE LTD	358,000	3.600	1,288,800.000	
	YESTAR INTERNATI	779,000	3.070	2,391,530.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 8,175,130.000 (130,066,318)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	GENERAL INTERFAC	40,000	137.000	5,480,000.000	
	MAKALOT INDUSTRI	11,384	241.000	2,743,544.000	
	CHICONY ELECT	196,250	77.600	15,229,000.000	

	LARGAN PRECISION	1,000	2,720.000	2,720,000.000	
	FENG TAY ENTERPR	21,000	189.000	3,969,000.000	
	RUENTEX DEVELOPM	91,461	40.450	3,699,597.450	
	TSMC	80,000	140.000	11,200,000.000	
	HON HAI PRECISIO	47,250	86.600	4,091,850.000	
	PRESIDENT CHAIN	40,000	217.000	8,680,000.000	
台湾・ドル	小計			台湾・ドル 57,812,991.450 (219,111,237)	
合計				1,011,854,289 [1,011,854,289]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリア・ドル	株式 15銘柄	100%	34.0%
シンガポール・ドル	株式 4銘柄	100%	8.6%
韓国・ウォン	株式 8銘柄	100%	22.8%
香港・ドル	株式 6銘柄	100%	12.9%
台湾・ドル	株式 9銘柄	100%	21.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,631,147,327	1,117,621,835
株式	64,476,598,200	53,137,116,000
投資証券	3,230,963,400	2,790,918,000
派生商品評価勘定	719,430	-
未収入金	3,610,497,926	2,217,504,502
未収配当金	818,555,796	428,192,240
前払金	2,000,000	-
差入委託証拠金	13,800,000	-
流動資産合計	74,784,282,079	59,691,352,577
資産合計	74,784,282,079	59,691,352,577
負債の部		
流動負債		
未払金	914,191,441	342,716,623
未払解約金	1,983,225,000	842,018,000
流動負債合計	2,897,416,441	1,184,734,623
負債合計	2,897,416,441	1,184,734,623
純資産の部		
元本等		
元本	1 28,763,888,766	23,174,176,675
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	43,122,976,872	35,332,441,279
元本等合計	71,886,865,638	58,506,617,954
純資産合計	71,886,865,638	58,506,617,954
負債純資産合計	74,784,282,079	59,691,352,577

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1. 1 期首	平成26年11月11日	平成27年5月9日
期首元本額	33,362,491,830円	28,763,888,766円
期中追加設定元本額	9,088,530,386円	5,110,009,190円
期中一部解約元本額	13,687,133,450円	10,699,721,281円
期末元本額の内訳 ファンド名		



ダイワ好配当日本株投信Q (FOFs用)(適格機関投資家 専用)	16,727,790,529円	9,424,096,415円
ダイワ好配当日本株投信(季 節点描)	10,000,676,910円	11,788,292,558円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	48,899,704円	45,874,440円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	57,637,107円	52,380,043円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	62,004,141円	55,054,477円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	996,165,248円	913,636,413円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	165,392,991円	148,518,048円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	184,936,158円	162,454,284円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	90,834,787円	97,297,224円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	184,991,464円	193,605,716円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	244,559,727円	292,967,057円
計	28,763,888,766円	23,174,176,675円
2. 期末日における受益権の総数	28,763,888,766口	23,174,176,675口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年5月9日 至 平成27年11月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	510,977,896	1,894,706,415
投資証券	55,594,542	209,231,859
合計	566,572,438	2,103,938,274

## （注）

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年4月16日から平成27年5月8日まで、及び平成27年10月16日から平成27年11月9日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	平成27年5月8日 現在				平成27年11月9日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	386,800,000	-	387,600,000	800,000	-	-	-	-
合計	386,800,000	-	387,600,000	800,000	-	-	-	-

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	平成27年5月8日現在	平成27年11月9日現在
1口当たり純資産額	2.4992円	2.5246円
(1万口当たり純資産額)	(24,992円)	(25,246円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額 (円)		備考
		単 価	金 額	
安藤・間	616,000	712.00	438,592,000	
北弘電社	278,000	403.00	112,034,000	
西松建設	640,000	487.00	311,680,000	

田辺工業	104,900	929.00	97,452,100
イチケン	469,000	423.00	198,387,000
名工建設	165,000	829.00	136,785,000
矢作建設	298,000	909.00	270,882,000
大東建託	17,900	12,790.00	228,941,000
前田道路	104,000	2,229.00	231,816,000
東洋建設	688,000	554.00	381,152,000
世紀東急	434,000	598.00	259,532,000
テクノクス	250,000	692.00	173,000,000
日成ビルド工業	1,060,000	388.00	411,280,000
大和ハウス	146,000	3,294.00	480,924,000
ライト工業	173,000	1,137.00	196,701,000
東京エネシス	78,000	1,175.00	91,650,000
九電工	76,000	2,348.00	178,448,000
太平電業	252,000	1,293.00	325,836,000
高橋カーテンウォール	81,200	946.00	76,815,200
トラスト・テック	182,000	2,378.00	432,796,000
G C A サヴィアン	236,000	1,394.00	328,984,000
エス・エム・エス	90,000	2,113.00	190,170,000
S Foods	84,000	2,097.00	176,148,000
システナ	39,000	1,180.00	46,020,000
新日鉄住金SOL	40,000	5,770.00	230,800,000
エイジア	26,000	1,352.00	35,152,000
キャリアデザインセンター	249,400	1,190.00	296,786,000
ワールドホールディングス	118,000	1,721.00	203,078,000
横浜冷凍	278,000	985.00	273,830,000
アルコニックス	181,800	1,694.00	307,969,200
ソリトンシステムズ	154,400	1,044.00	161,193,600
あいホールディングス	84,000	3,015.00	253,260,000
サイボー	106,600	505.00	53,833,000
アーバネットコーポレーション	371,000	287.00	106,477,000
サムティ	324,400	1,215.00	394,146,000
ユニゾホールディングス	54,000	4,865.00	262,710,000
サンセイランディック	347,700	969.00	336,921,300
日本調剤	31,000	5,010.00	155,310,000
クリヤマホールディングス	208,600	1,630.00	340,018,000
帝人	580,000	415.00	240,700,000
サカイオーベックス	324,000	213.00	69,012,000
ケー・エフ・シー	160,100	2,580.00	413,058,000
サンコーテクノ	171,200	1,206.00	206,467,200

共和レザー	72,000	974.00	70,128,000
エムアップ	47,000	654.00	30,738,000
S R Aホールディングス	162,400	2,567.00	416,880,800
アバント	133,000	1,575.00	209,475,000
神島化学	110,000	473.00	52,030,000
東ソー	708,000	664.00	470,112,000
関東電化	764,000	995.00	760,180,000
デンカ	520,000	572.00	297,440,000
第一稀元素化学工	31,400	5,140.00	161,396,000
日本化学工業	78,000	279.00	21,762,000
協和発酵キリン	120,000	2,093.00	251,160,000
三井化学	510,000	489.00	249,390,000
宇部興産	1,060,000	252.00	267,120,000
積水化成品	364,000	395.00	143,780,000
タイガース ポリマー	229,000	734.00	168,086,000
日本化薬	120,000	1,365.00	163,800,000
日本エス・エイチ・エル	17,400	2,700.00	46,980,000
扶桑化学工業	223,000	1,652.00	368,396,000
科研製薬	12,000	8,060.00	96,720,000
小野薬品	14,000	16,895.00	236,530,000
ダイト	50,000	2,826.00	141,300,000
中国塗料	72,000	900.00	64,800,000
日本特殊塗料	86,500	1,115.00	96,447,500
D I C	446,000	325.00	144,950,000
クレスコ	100,000	1,997.00	199,700,000
フューチャーアーキテクト	199,000	684.00	136,116,000
オービックビジネスC	8,000	7,440.00	59,520,000
テー・オー・ダブリュー	294,000	815.00	239,610,000
大塚商会	40,000	5,750.00	230,000,000
日本ハウズイング	25,500	3,555.00	90,652,500
山田コンサルティングG P	48,300	3,340.00	161,322,000
コーセー	10,000	11,490.00	114,900,000
ポーラ・オルビスHD	26,000	7,840.00	203,840,000
デクセリアルズ	320,000	1,348.00	431,360,000
寺岡製作所	214,700	450.00	96,615,000
東燃ゼネラル石油	394,000	1,285.00	506,290,000
オカモト	400,000	1,004.00	401,600,000
相模ゴム	138,000	1,024.00	141,312,000
有沢製作所	618,300	815.00	503,914,500
ノザワ	569,000	577.00	328,313,000

トーヨーアサノ	68,000	167.00	11,356,000	
ヨシコン	46,000	1,195.00	54,970,000	
クニミネ工業	257,000	694.00	178,358,000	
共英製鋼	134,000	2,069.00	277,246,000	
山陽特殊製鋼	66,000	515.00	33,990,000	
日本精線	487,000	559.00	272,233,000	
古河機金	192,000	257.00	49,344,000	
日本精鉱	271,000	314.00	85,094,000	
U A C J	200,000	275.00	55,000,000	
横河ブリッジH L D G S	154,000	1,142.00	175,868,000	
東 プ レ	62,000	2,663.00	165,106,000	
東京製鋼	1,300,000	194.00	252,200,000	
スーパーツール	305,000	453.00	138,165,000	
タ ク マ	84,000	980.00	82,320,000	
ダイハツデイ - ゼル	233,000	789.00	183,837,000	
テクノプロ・ホールディング	283,000	3,515.00	994,745,000	
ジャパンマテリアル	110,000	2,013.00	221,430,000	
小池酸素	50,000	345.00	17,250,000	
日進工具	35,000	2,199.00	76,965,000	
日本郵政	69,100	1,702.00	117,608,200	
レオン自動機	330,000	689.00	227,370,000	
日精樹脂工業	159,000	979.00	155,661,000	
オカダアイヨン	260,000	1,098.00	285,480,000	
北川鉄工所	536,000	321.00	172,056,000	
鶴見製作所	163,500	2,269.00	370,981,500	
三精テクノロジーズ	51,400	757.00	38,909,800	
北越工業	269,000	871.00	234,299,000	
兼松エンジニアリング	33,000	990.00	32,670,000	
明 電 舎	551,000	408.00	224,808,000	
愛知電機	680,000	360.00	244,800,000	
S E M I T E C	79,400	1,328.00	105,443,200	
寺崎電気産業	365,500	1,182.00	432,021,000	
戸上電機	512,000	549.00	281,088,000	
能美防災	200,000	1,499.00	299,800,000	
ホーチキ	137,000	1,220.00	167,140,000	
日立国際電気	198,000	1,755.00	347,490,000	
T D K	21,000	8,840.00	185,640,000	
アルプス電気	140,000	3,980.00	557,200,000	
スミダコーポレーション	442,000	776.00	342,992,000	
リオン	118,000	1,808.00	213,344,000	

本多通信工業	101,000	964.00	97,364,000	
協立電機	2,400	1,655.00	3,972,000	
山一電機	385,000	895.00	344,575,000	
富士通フロンテック	197,000	1,545.00	304,365,000	
芝浦電子	1,100	1,718.00	1,889,800	
村田製作所	28,800	19,565.00	563,472,000	
名村造船所	12,000	1,039.00	12,468,000	
ゆうちょ銀行	223,400	1,670.00	373,078,000	
日産自動車	1,230,000	1,285.00	1,580,550,000	
トヨタ自動車	128,000	7,625.00	976,000,000	
新明和工業	314,000	1,311.00	411,654,000	
カルソニックカンセイ	300,000	1,042.00	312,600,000	
太平洋工業	13,600	1,352.00	18,387,200	
河西工業	402,000	1,615.00	649,230,000	
マ ッ ダ	294,000	2,526.50	742,791,000	
富士重工業	88,000	5,014.00	441,232,000	
ジャムコ	46,000	4,140.00	190,440,000	
ノ ジ マ	129,000	1,650.00	212,850,000	
アドヴァン	141,200	1,103.00	155,743,600	
萩原電気	118,000	1,995.00	235,410,000	
岡谷鋼機	9,300	8,710.00	81,003,000	
丸文	314,000	919.00	288,566,000	
ハークスレイ	119,000	1,380.00	164,220,000	
日本ライフライン	158,500	1,183.00	187,505,500	
白銅	196,000	1,395.00	273,420,000	
バンダイナムコHLDGS	30,000	2,819.00	84,570,000	
SHOEI	108,400	2,170.00	235,228,000	
桑山	131,300	640.00	84,032,000	
ニ ッ ピ	414,000	730.00	302,220,000	
ニ チ ハ	126,000	1,714.00	215,964,000	
ビジョン	83,000	3,340.00	277,220,000	
天馬	94,700	2,184.00	206,824,800	
ナカバヤシ	12,000	327.00	3,924,000	
岡村製作所	2,000	1,142.00	2,284,000	
伊 藤 忠	744,000	1,568.50	1,166,964,000	
住友商事	70,000	1,343.50	94,045,000	
三谷商事	70,800	2,915.00	206,382,000	
フルサト工業	91,400	1,742.00	159,218,800	
ニチモウ	89,000	213.00	18,957,000	
稲畑産業	346,000	1,419.00	490,974,000	

三信電気	248,000	1,433.00	355,384,000	
加賀電子	218,000	1,808.00	394,144,000	
大塚家具	157,000	1,732.00	271,924,000	
フォーバル	62,000	729.00	45,198,000	
あおぞら銀行	3,536,000	445.00	1,573,520,000	
三菱UFJフィナンシャルG	510,000	822.20	419,322,000	
三井住友フィナンシャルG	170,000	5,118.00	870,060,000	
ふくおかフィナンシャルG	90,000	643.00	57,870,000	
大分銀行	390,000	513.00	200,070,000	
宮崎銀行	363,000	443.00	160,809,000	
みずほフィナンシャルG	2,960,000	256.60	759,536,000	
オリックス	76,000	1,841.50	139,954,000	
MS & AD	174,000	3,815.00	663,810,000	
第一生命	212,000	2,342.50	496,610,000	
スターツコーポレーション	148,100	1,903.00	281,834,300	
シノケングループ	239,000	1,770.00	423,030,000	
東海旅客鉄道	5,600	22,205.00	124,348,000	
鴻池運輸	17,000	1,531.00	26,027,000	
センコー	344,000	836.00	287,584,000	
トナミホールディングス	592,000	354.00	209,568,000	
日本航空	150,000	4,639.00	695,850,000	
東陽倉庫	25,000	255.00	6,375,000	
日本コンセプト	142,800	1,025.00	146,370,000	
日本電信電話	326,000	4,813.00	1,569,038,000	
沖縄セルラー電話	66,200	3,245.00	214,819,000	
セレスポ	171,000	357.00	61,047,000	
三協フロンテア	139,000	924.00	128,436,000	
スクウェア・エニックス・HD	155,000	3,125.00	484,375,000	
シーイーシー	295,000	1,053.00	310,635,000	
トランス・コスモス	74,000	3,275.00	242,350,000	
ジャステック	104,000	1,162.00	120,848,000	
SCSK	34,000	4,660.00	158,440,000	
東海リース	528,000	221.00	116,688,000	
丸紅建材リース	1,857,000	225.00	417,825,000	
ステップ	123,000	1,056.00	129,888,000	
パーカーコーポレーション	506,000	395.00	199,870,000	
バイテックホールディングス	300,800	1,310.00	394,048,000	
東テク	277,600	894.00	248,174,400	
ジェコス	284,000	1,078.00	306,152,000	
合計			53,137,116,000	



## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,220	1,110,900,000	
	星野リゾート・リート	188	225,600,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	16,660	1,454,418,000	
投資証券 合計			2,790,918,000	
合計			2,790,918,000	

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。

## 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。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成27年11月30日

資産総額	4,080,927,106円
負債総額	7,276,029円
純資産総額（ - ）	4,073,651,077円
発行済数量	4,078,417,697口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9988円

## (参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	49,009,646,312円
負債総額	539,423,864円
純資産総額（ - ）	48,470,222,448円
発行済数量	28,277,352,457口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7141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

平成27年11月30日

資産総額	158,517,486,893円
負債総額	1,152,201,832円
純資産総額（ - ）	157,365,285,061円
発行済数量	75,587,232,992口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0819円

## (参考) ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	77,755,683,980円
負債総額	875,206,958円
純資産総額( - )	76,880,477,022円
発行済数量	34,535,476,613口
1単位当たり純資産額( / )	2.2261円

## (参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	2,117,999,793円
負債総額	3,697,000円
純資産総額( - )	2,114,302,793円
発行済数量	976,133,690口
1単位当たり純資産額( / )	2.1660円

## (参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	1,498,613,377円
負債総額	28,000円
純資産総額( - )	1,498,585,377円
発行済数量	946,877,075口
1単位当たり純資産額( / )	1.5827円

## (参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	1,142,649,211円
負債総額	11,000,173円
純資産総額（ - ）	1,131,649,038円
発行済数量	580,563,300口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.9492円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成27年11月30日

資産総額	48,624,722,383円
負債総額	174,163,673円
純資産総額（ - ）	48,450,558,710円
発行済数量	19,127,303,562口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.5331円

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成27年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

###### ・ファンド評価会議

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

- ・運用審査会議

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

- ・リスクマネジメント会議

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

- ・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	30	151,387
追加型株式投資信託	599	11,972,362
株式投資信託 合計	629	12,123,749
単位型公社債投資信託	2	21,533
追加型公社債投資信託	17	3,124,529
公社債投資信託 合計	19	3,146,062
総合計	648	15,269,811



## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第57期事業年度に係る中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	1
建物	252	255
器具備品	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	-

投資その他の資産	15,077		12,979
投資有価証券	8,338		6,667
関係会社株式	5,141		5,129
出資金	129		124
長期差入保証金	997		996
投資不動産	1	398	1
その他		74	
貸倒引当金		3	
固定資産計		18,320	
資産合計		57,727	
			63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金		53		64
未払金		8,998		9,172
未払収益分配金		7		5
未払償還金		77		72
未払手数料		4,277		4,965
その他未払金	2	4,635	2	4,127
未払費用		3,463		4,162
未払法人税等		1,530		1,133
未払消費税等		530		1,429
賞与引当金		955		1,092
その他		1		747
流動負債計		15,534		17,801
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		1,959		2,072
役員退職慰労引当金		80		101
繰延税金負債		1,789		1,745
その他		3		2
固定負債計		3,832		3,920
負債合計		19,366		21,722
<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
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092

福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17
法人税等合計		6,375		6,220
当期純利益		10,126		13,431

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	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	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

	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	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	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	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

## 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) 子会社及び関連会社株式

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) 有形固定資産及び投資不動産

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	8～47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) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

### (2) 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。

### (3) 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。

### (4) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (貸借対照表)

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。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、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。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、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。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、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。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、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。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、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

#### （損益計算書）

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。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、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」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「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万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」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し



いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。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」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。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、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

#### 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

#### 3 保証債務

前事業年度(平成26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。

当事業年度(平成27年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

### (損益計算書関係)

#### 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

平成26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	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年 3月31日
効力発生日	平成26年 6月26日

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26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

平成27年6月23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	13,428百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,148円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27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、「証券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。証券投資信託は余資運用及び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ます。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ます。

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186	15,186	-
(2) 未収委託者報酬	8,265	8,265	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	22,283	22,283	-
資産計	45,735	45,735	-
(1) 未払手数料	4,277	4,277	-
(2) その他未払金	4,635	4,635	-
(3) 未払費用(*)	2,678	2,678	-
負債計	11,591	11,591	-

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

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,438	31,438	-
(2) 未収委託者報酬	10,295	10,295	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	10,520	10,520	-
資産計	52,254	52,254	-
(1) 未払手数料	4,965	4,965	-
(2) その他未払金	4,127	4,127	-
(3) 未払費用(*)	3,366	3,366	-
負債計	12,460	12,460	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26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	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成26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	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)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(平成27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	164	55	109
(2) その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
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	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,025百万円)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 平成25年4月1日 至 平成26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)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	32	-	1
(2) その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

## 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、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

## 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172百万円、当事業年度170百万円であります。

## (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	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203



その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、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以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)	1,719	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	----------	-------	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26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)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
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	678	未払費用	393
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	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27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)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	28,838	未払手数料	3,751
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	685	未払費用	348
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	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(平成27年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金

22,998

有価証券		4,461
未収委託者報酬		10,719
繰延税金資産		504
その他		334
流動資産合計		39,018
固定資産		
有形固定資産	1	247
無形固定資産		
ソフトウェア		2,432
その他		135
無形固定資産合計		2,568
投資その他の資産		
投資有価証券		5,468
関係会社株式		5,129
その他		1,231
投資その他の資産合計		11,830
固定資産合計		14,646
資産合計		53,664

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（平成27年9月30日）

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,124
未払費用		4,744
未払法人税等		1,085
賞与引当金		903
その他	3	643

流動負債合計 14,500

## 固定負債

退職給付引当金		2,142
役員退職慰労引当金		111
繰延税金負債		1,497
その他		2

固定負債合計 3,754

負債合計	18,255
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,096
利益剰余金合計	8,471
株主資本合計	35,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	35,409
負債・純資産合計	53,664

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成27年4月1日	
	至 平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		46,714
その他営業収益		435
営業収益合計		47,150
営業費用		
支払手数料		24,499
その他営業費用		6,487
営業費用合計		30,987
一般管理費	1	5,812
営業利益		10,350
営業外収益	2	378
営業外費用	3	29
経常利益		10,699
税引前中間純利益		10,699
法人税、住民税及び事業税		3,260
法人税等調整額		39
中間純利益		7,398

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,428	△ 13,428	△ 13,428
中間純利益	-	-	-	7,398	7,398	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 6,029	△ 6,029	△ 6,029
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,096	8,471	35,141

	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	702	702	41,873
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,428
中間純利益	-	-	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 434	△ 434	△ 434
当中間期変動額合計	△ 434	△ 434	△ 6,464
当中間期末残高	267	267	35,409

## 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) 子会社及び関連会社株式

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

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

## 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日現在)
有形固定資産	239百万円

## 2 保証債務

当中間会計期間（平成27年9月30日現在）



子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,765百万円に対して保証を行っております。

### 3 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

#### 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
有形固定資産	15百万円
無形固定資産	532百万円

#### 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
外国税関連費用引当金戻入益	171百万円
投資有価証券売却益	99百万円
受取配当金	69百万円

#### 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
為替差損	13百万円
貯蔵品廃棄損	5百万円
投資有価証券売却損	2百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27 年 3月 31日	平成27年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,998	22,998	-
(2) 未収委託者報酬	10,719	10,719	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,908	8,908	-
資産合計	42,626	42,626	-
(1) 未払金	7,124	7,124	-
(2) 未払費用(*)	3,702	3,702	-
負債合計	10,827	10,827	-

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,052

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	161	55	106
（2）その他			
証券投資信託	3,455	3,002	453
小計	3,617	3,058	559
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	5,290	5,453	163
小計	5,290	5,453	163
合計	8,908	8,511	396

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）	
1 株当たり純資産額	13,574.37円
1 株当たり中間純利益金額	2,836.44円

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

(注) 2 . 1 株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日)	
中間純利益(百万円)	7,398
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,398
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成27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 信金中央金庫

資本金の額 490,998百万円（平成27年3月末日現在）

事業の内容

全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」および「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 486千米ドル（約58百万円）（平成26年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

<参考> 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド

資本金の額 1,033千ユーロ（約151百万円）（平成26年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

### 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。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（平成27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 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
平成27年5月18日	臨時報告書（開示府令第29条第2項第4号に基づく報告書）
平成27年7月21日	臨時報告書（開示府令第29条第2項第4号に基づく報告書）
平成27年7月31日	有価証券届出書、有価証券報告書（第16特定期間）
平成27年9月18日	臨時報告書（開示府令第29条第2項第4号に基づく報告書）

。

**独立監査人の監査報告書**

平成27年 5月28日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月11日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）の平成27年5月9日から平成27年11月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）の平成27年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成27年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。