

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成30年3月28日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 岩本 信之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 高橋 慎
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド
（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド
（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド
（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）
（総称を「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券
ファンド（通貨選択型）」とします。）

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で30兆円を上限と
します。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2017年9月26日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

1

アジアのハイ・イールド債券に投資します。

- ビジネスの大半をアジアで営んでいるとフィデリティが判断する企業が発行する債券のうち、BB格相当以下※の債券（ハイ・イールド債券）に投資します。

※ムーディーズでBa1以下またはS&PでBB+以下もしくはフィッチでBB+以下。無格付けを含みます。

ハイ・イールド債券とは

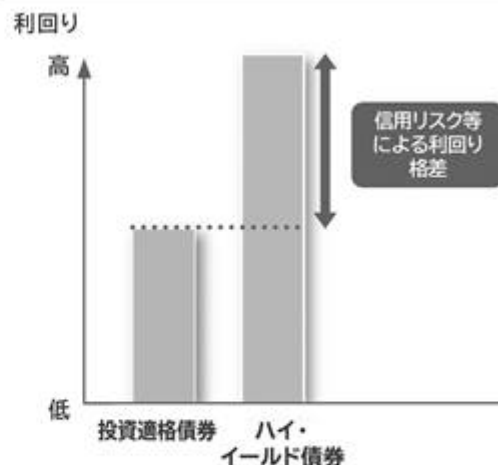
- ◆ 格付会社によってBB格相当以下に格付けされている社債のことです。
- ◆ 一般に、投資適格債券と比較して信用リスク^(※)が高い反面、利回りが高いという特徴があります。
(※) 発行体の財務内容の悪化等により、債券の元本、利息の支払いが滞ったり支払われなくなるリスクのこと。

信用リスクと債券の格付けについて

信用リスク	格付け		
	ムーディーズの場合	S&Pの場合	フィッチ・レーティングスの場合
低い ↑ 投資適格債券	Aaa	AAA	AAA
	Aa	AA	AA
	A	A	A
	Baa	BBB	BBB
高い ↓ ハイ・イールド債券	Ba	BB	BB
	B	B	B
	Caa	CCC	CCC
	Ca	CC	CC
	C	C	C

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ (Moody's) やS&Pグローバル・レーティング (S&P)、フィッチ・レーティングス (Fitch) 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。

投資適格債券とハイ・イールド債券の利回り



※上記はイメージであり、実際の利回りとは異なります。

<略>

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（2018年1月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 更新後 >

< 略 >

上記の運用体制は2018年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

3 【投資リスク】

< 更新後 >

< 略 >

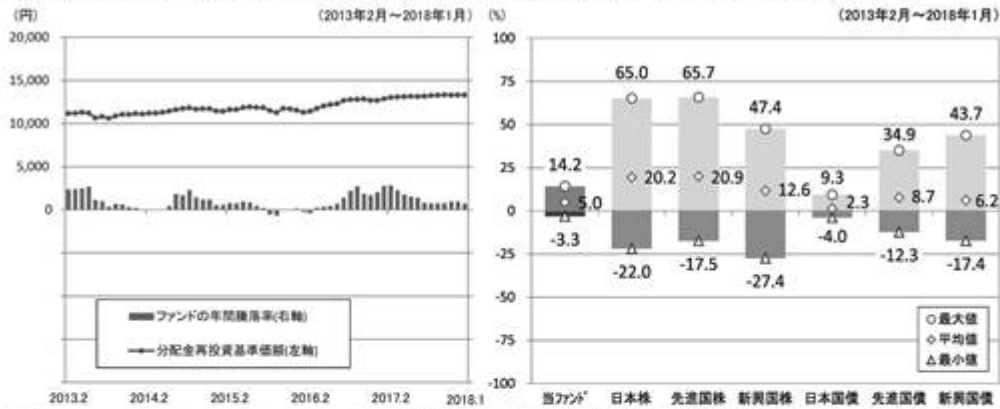
■ 参考情報

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

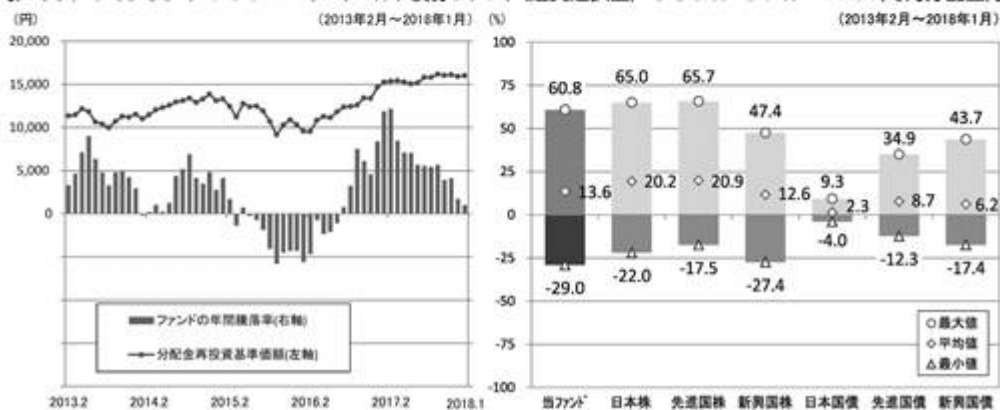
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

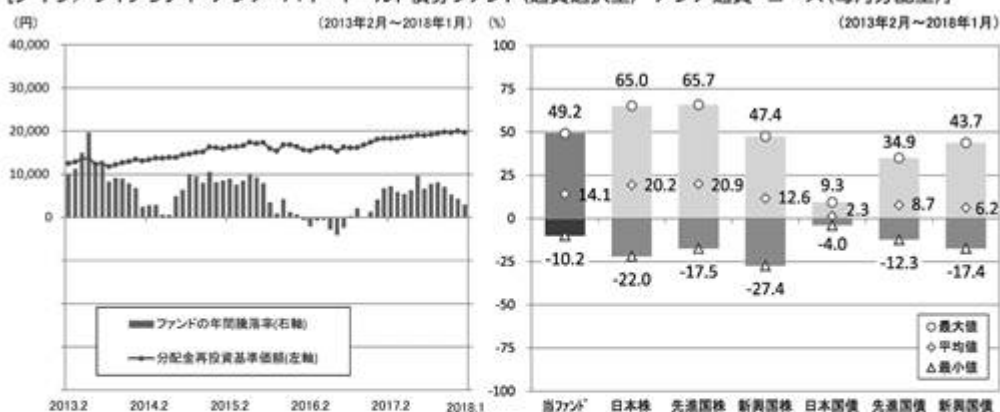
[ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) 日本円・コース(毎月分配型)]



[ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)]



[ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) アジア通貨・コース(毎月分配型)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

() 上記は、2018年1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。

<略>

5 【運用状況】

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

<訂正後>

【ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）】

(1) 【投資状況】（平成30年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,068,935,483	98.47
内 ケイマン諸島	1,068,935,483	98.47
親投資信託受益証券	1,002	0.00
内 日本	1,002	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,609,827	1.53
純資産総額	1,085,546,312	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30年1月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-JPY CLASS	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	11,612,931.25	92.26 1,071,482,091	92.04 1,068,935,483	98.47
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	998	1.0045 1,002	1.0045 1,002	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.47%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.47%

(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24年1月4日)	2,923,706,094	2,939,636,210	0.9177	0.9227
第2特定期間末 (平成24年7月3日)	2,785,067,481	2,799,530,147	0.9628	0.9678
第3特定期間末 (平成25年1月4日)	2,664,985,311	2,678,010,536	1.0230	1.0280
第4特定期間末 (平成25年7月3日)	2,297,050,656	2,308,923,404	0.9674	0.9724
第5特定期間末 (平成26年1月6日)	2,032,600,719	2,043,068,661	0.9709	0.9759
第6特定期間末 (平成26年7月3日)	1,728,035,843	1,736,848,840	0.9804	0.9854
第7特定期間末 (平成27年1月5日)	1,339,208,930	1,346,344,913	0.9383	0.9433
第8特定期間末 (平成27年7月3日)	1,259,670,351	1,266,357,932	0.9418	0.9468
第9特定期間末 (平成28年1月4日)	1,033,307,470	1,039,153,036	0.8838	0.8888
第10特定期間末 (平成28年7月4日)	957,076,674	962,311,886	0.9141	0.9191
第11特定期間末 (平成29年1月4日)	1,036,833,239	1,042,521,186	0.9114	0.9164
平成29年1月末日	1,172,727,141	-	0.9230	-
2月末日	1,229,493,361	-	0.9301	-
3月末日	1,138,123,039	-	0.9287	-
4月末日	1,153,718,587	-	0.9261	-
5月末日	1,165,294,953	-	0.9232	-
6月末日	1,161,654,432	-	0.9174	-
第12特定期間末 (平成29年7月3日)	1,154,086,926	1,160,418,371	0.9114	0.9164
7月末日	1,105,727,996	-	0.9148	-
8月末日	1,126,354,156	-	0.9152	-
9月末日	1,181,603,112	-	0.9123	-
10月末日	1,144,852,926	-	0.9115	-
11月末日	1,131,208,917	-	0.9040	-
12月末日	1,113,607,439	-	0.8994	-
第13特定期間末 (平成30年1月4日)	1,107,379,578	1,113,570,204	0.8944	0.8994

平成30年1月末日	1,085,546,312	-	0.8948	-
-----------	---------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0150
第2特定期間	0.0300
第3特定期間	0.0300
第4特定期間	0.0300
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300
第11特定期間	0.0300
第12特定期間	0.0300
第13特定期間	0.0300

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	6.7
第2特定期間	8.2
第3特定期間	9.4
第4特定期間	2.5
第5特定期間	3.5
第6特定期間	4.1
第7特定期間	1.2
第8特定期間	3.6
第9特定期間	3.0
第10特定期間	6.8
第11特定期間	3.0
第12特定期間	3.3
第13特定期間	1.4

(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	2,457,415,419	223,691,515
第2特定期間	1,038,760,172	1,332,250,223
第3特定期間	1,040,791,760	1,328,279,965
第4特定期間	349,874,548	580,369,875
第5特定期間	207,268,777	488,230,042
第6特定期間	154,571,567	485,560,593
第7特定期間	54,920,246	390,323,115
第8特定期間	50,522,022	140,202,284
第9特定期間	45,475,049	213,878,043
第10特定期間	176,051,465	298,122,254
第11特定期間	251,316,372	160,769,392
第12特定期間	366,240,447	237,540,801

第13特定期間	158,797,555	186,961,508
---------	-------------	-------------

(注) 当初設定数量は952,299,439口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	128,241,828,451	100.00
純資産総額	128,241,828,451	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30年1月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

該当事項はありません。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

【ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)】

(1) 【投資状況】 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	9,474,790,850	98.18
内 ケイマン諸島	9,474,790,850	98.18
親投資信託受益証券	1,002	0.00
内 日本	1,002	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	175,192,412	1.82

純資産総額	9,649,984,264	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30年1月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-BRL CLASS	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	166,320,691.8	56.78 9,445,265,530	56.96 9,474,790,850	98.18
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファン ド	日本	親投資信 託受益証 券	998	1.0045 1,002	1.0045 1,002	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.18%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.18%

(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24年1月4日)	47,259,362,985	48,016,393,849	0.7491	0.7611
第2特定期間末 (平成24年7月3日)	47,417,502,341	48,189,363,969	0.7372	0.7492
第3特定期間末 (平成25年1月4日)	41,823,388,326	42,234,926,259	0.8130	0.8210
第4特定期間末 (平成25年7月3日)	31,436,019,671	31,744,568,961	0.8151	0.8231

第5特定期間末 (平成26年1月6日)	25,042,922,951	25,286,361,318	0.8230	0.8310
第6特定期間末 (平成26年7月3日)	22,806,435,442	23,015,077,397	0.8745	0.8825
第7特定期間末 (平成27年1月5日)	20,132,575,605	20,324,559,834	0.8389	0.8469
第8特定期間末 (平成27年7月3日)	16,883,920,224	17,061,208,582	0.7619	0.7699
第9特定期間末 (平成28年1月4日)	11,422,605,760	11,587,670,525	0.5536	0.5616
第10特定期間末 (平成28年7月4日)	11,531,911,976	11,683,121,017	0.6101	0.6181
第11特定期間末 (平成29年1月4日)	11,531,363,836	11,664,581,122	0.6925	0.7005
平成29年1月末日	11,863,241,435	-	0.7217	-
2月末日	11,517,906,614	-	0.7182	-
3月末日	11,373,790,069	-	0.7131	-
4月末日	11,102,806,218	-	0.6984	-
5月末日	10,675,079,743	-	0.6813	-
6月末日	10,560,200,153	-	0.6781	-
第12特定期間末 (平成29年7月3日)	10,400,705,087	10,525,872,549	0.6648	0.6728
7月末日	10,896,699,072	-	0.6985	-
8月末日	10,614,936,710	-	0.6904	-
9月末日	10,775,086,277	-	0.6989	-
10月末日	10,350,552,280	-	0.6849	-
11月末日	10,192,817,461	-	0.6799	-
12月末日	9,821,947,556	-	0.6635	-
第13特定期間末 (平成30年1月4日)	9,647,709,356	9,766,135,154	0.6517	0.6597
平成30年1月末日	9,649,984,264	-	0.6589	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0360
第2特定期間	0.0720
第3特定期間	0.0640
第4特定期間	0.0480
第5特定期間	0.0480
第6特定期間	0.0480
第7特定期間	0.0480
第8特定期間	0.0480
第9特定期間	0.0480
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	21.5
第2特定期間	8.0
第3特定期間	19.0
第4特定期間	6.2
第5特定期間	6.9
第6特定期間	12.1
第7特定期間	1.4
第8特定期間	3.5
第9特定期間	21.0
第10特定期間	18.9
第11特定期間	21.4
第12特定期間	2.9
第13特定期間	5.2

(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	17,463,056,603	1,433,555,575
第2特定期間	5,615,347,102	4,379,450,144
第3特定期間	2,846,745,791	15,726,306,415
第4特定期間	1,685,934,776	14,559,515,217
第5特定期間	412,240,594	8,551,105,970
第6特定期間	198,511,646	4,548,063,092
第7特定期間	266,438,366	2,348,654,160
第8特定期間	152,315,042	1,989,298,931
第9特定期間	275,269,291	1,803,218,315
第10特定期間	216,882,534	1,948,848,095
第11特定期間	546,727,069	2,795,696,415
第12特定期間	942,822,400	1,949,050,461
第13特定期間	683,132,265	1,525,840,242

(注) 当初設定数量は47,056,404,348口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)」の記載と同じ。

【ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)アジア通貨・コース(毎月分配型)】

(1) 【投資状況】(平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

投資信託受益証券	2,258,165,148	98.49
内 ケイマン諸島	2,258,165,148	98.49
親投資信託受益証券	1,002	0.00
内 日本	1,002	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	34,569,366	1.51
純資産総額	2,292,735,516	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30年1月31日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-ACC CLASS	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	24,349,156.77	95.14 2,316,718,801	92.74 2,258,165,148	98.49
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	998	1.0045 1,002	1.0045 1,002	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.49%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.49%

(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24年1月4日)	4,026,004,050	4,069,344,789	0.8360	0.8450
第2特定期間末 (平成24年7月3日)	5,056,165,246	5,108,269,144	0.8734	0.8824

第3特定期間末 (平成25年1月4日)	4,327,289,081	4,366,577,910	0.9913	1.0003
第4特定期間末 (平成25年7月3日)	4,062,474,389	4,097,287,639	1.0502	1.0592
第5特定期間末 (平成26年1月6日)	3,391,404,403	3,420,681,210	1.0426	1.0516
第6特定期間末 (平成26年7月3日)	2,909,514,034	2,934,836,605	1.0341	1.0431
第7特定期間末 (平成27年1月5日)	3,084,018,021	3,108,700,508	1.1245	1.1335
第8特定期間末 (平成27年7月3日)	2,546,379,908	2,566,257,598	1.1529	1.1619
第9特定期間末 (平成28年1月4日)	2,009,684,618	2,027,047,624	1.0417	1.0507
第10特定期間末 (平成28年7月4日)	1,645,477,178	1,661,447,208	0.9273	0.9363
第11特定期間末 (平成29年1月4日)	1,680,020,638	1,694,661,129	1.0328	1.0418
平成29年1月末日	1,698,819,854	-	1.0420	-
2月末日	1,683,728,103	-	1.0294	-
3月末日	1,729,249,441	-	1.0312	-
4月末日	1,712,516,595	-	1.0319	-
5月末日	1,715,124,676	-	1.0306	-
6月末日	1,760,888,692	-	1.0392	-
第12特定期間末 (平成29年7月3日)	1,737,825,591	1,753,055,595	1.0269	1.0359
7月末日	1,811,100,951	-	1.0258	-
8月末日	1,878,594,306	-	1.0278	-
9月末日	2,193,770,154	-	1.0327	-
10月末日	2,316,296,230	-	1.0394	-
11月末日	2,275,916,591	-	1.0264	-
12月末日	2,315,104,238	-	1.0349	-
第13特定期間末 (平成30年1月4日)	2,299,569,455	2,319,731,618	1.0265	1.0355
平成30年1月末日	2,292,735,516	-	1.0078	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0270
第2特定期間	0.0540
第3特定期間	0.0540
第4特定期間	0.0540
第5特定期間	0.0540
第6特定期間	0.0540
第7特定期間	0.0540
第8特定期間	0.0540

第9特定期間	0.0540
第10特定期間	0.0540
第11特定期間	0.0540
第12特定期間	0.0540
第13特定期間	0.0540

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	13.7
第2特定期間	10.9
第3特定期間	19.7
第4特定期間	11.4
第5特定期間	4.4
第6特定期間	4.4
第7特定期間	14.0
第8特定期間	7.3
第9特定期間	5.0
第10特定期間	5.8
第11特定期間	17.2
第12特定期間	4.7
第13特定期間	5.2

(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	1,712,058,472	110,327,538
第2特定期間	2,448,758,555	1,475,074,163
第3特定期間	753,617,761	2,177,514,319
第4特定期間	1,045,961,947	1,543,248,546
第5特定期間	59,245,058	674,405,378
第6特定期間	89,120,309	528,479,904
第7特定期間	118,476,120	189,596,578
第8特定期間	55,494,669	589,361,005
第9特定期間	51,234,319	330,643,669
第10特定期間	16,810,136	171,585,208
第11特定期間	29,175,374	176,901,943
第12特定期間	157,561,990	92,060,542
第13特定期間	764,685,314	216,667,628

(注) 当初設定数量は3,213,906,783口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)」の記載と同じ。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) 日本円・コース(毎月分配型)

2018年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,948円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	0.0%
3か月間	-0.2%
6か月間	1.1%
1年間	3.5%
3年間	16.7%
5年間	19.5%
設定来	33.0%



※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実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 600円 設定来分配金合計額: 3,750円

決算期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期	第78期
	17年2月	17年3月	17年4月	17年5月	17年6月	17年7月	17年8月	17年9月	17年10月	17年11月	17年12月	18年1月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50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。

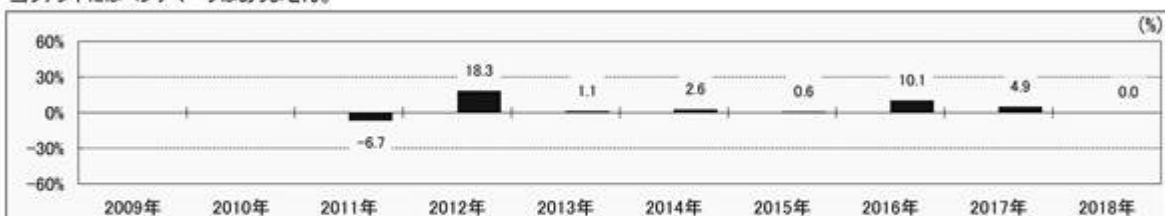
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
FILインベストメント・マネジメント(香港)・リテッド/ダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)・リテッド	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(日本円・クラス)	98.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		98.5%

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。
・2011年は設定日(7月22日)から年末、2018年は1月31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。

(参考情報) 運用実績

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)

2018年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	6,589円
純資産総額	96億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	0.5%
3か月間	-0.3%
6か月間	1.2%
1年間	4.9%
3年間	20.3%
5年間	44.1%
設定来	60.0%



※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実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 960円 設定来分配金合計額: 6,520円

決算期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期	第78期
	17年2月	17年3月	17年4月	17年5月	17年6月	17年7月	17年8月	17年9月	17年10月	17年11月	17年12月	18年1月
分配金	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80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。

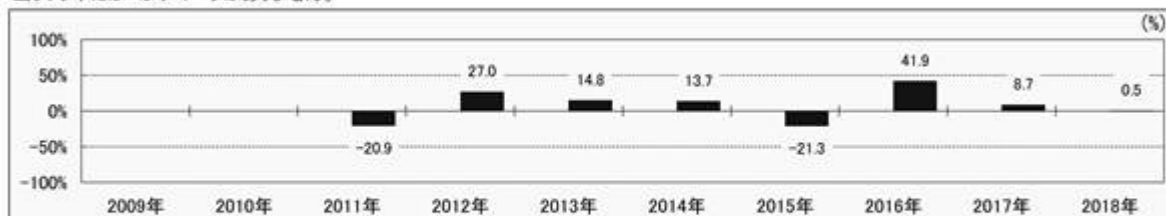
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッド/ダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)・リミテッド	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(ブラジル・レアル・クラス)	98.2%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		98.2%

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。
・2011年は設定日(7月22日)から年末、2018年は1月31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。

(参考情報) 運用実績

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) アジア通貨・コース(毎月分配型)

2018年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,078円
純資産総額	22億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.8%
3カ月間	-0.5%
6カ月間	3.5%
1年間	7.4%
3年間	23.8%
5年間	59.3%
設定来	96.4%



※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実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 1,080円 設定来分配金合計額: 6,750円

決算期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期	第78期
	17年2月	17年3月	17年4月	17年5月	17年6月	17年7月	17年8月	17年9月	17年10月	17年11月	17年12月	18年1月
分配金	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90円	90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。

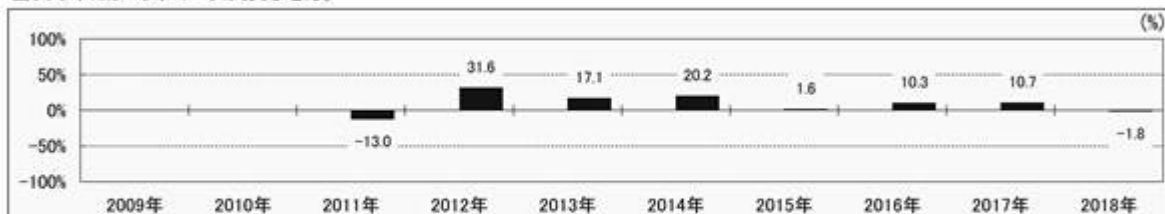
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
FILインベストメント・マネジメント(香港)・リテッド/ダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リテッド	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(アジア通貨・クラス)	98.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		98.5%

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。
・2011年は設定日(7月22日)から年末、2018年は1月31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。

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）

(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29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	平成29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,661,266	21,131,283
投資信託受益証券	1,110,850,903	1,094,463,032
親投資信託受益証券	1,002	1,002
未収入金	29,999,999	-
流動資産合計	1,161,513,170	1,115,595,317
資産合計	1,161,513,170	1,115,595,317
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,331,445	6,190,626
未払解約金	917	873,185
未払受託者報酬	29,095	30,706
未払委託者報酬	1,018,507	1,074,930
その他未払費用	46,280	46,292
流動負債合計	7,426,244	8,215,739
負債合計	7,426,244	8,215,739
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,266,289,181	1,238,125,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2 112,202,255	130,745,650
(分配準備積立金)	3,659,112	-
元本等合計	1,154,086,926	1,107,379,578
純資産合計	1,154,086,926	1,107,379,578
負債純資産合計	1,161,513,170	1,115,595,317

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	30,760,589	25,295,464
有価証券売買等損益	12,627,662	2,683,334
営業収益合計	43,388,251	22,612,130
営業費用		
支払利息	7,099	5,134
受託者報酬	185,463	185,513
委託者報酬	6,492,591	6,494,453
その他費用	46,490	46,292
営業費用合計	6,731,643	6,731,392
営業利益	36,656,608	15,880,738
経常利益	36,656,608	15,880,738
当期純利益	36,656,608	15,880,738
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,023,078	123,088
期首剰余金又は期首欠損金 ()	100,756,296	112,202,255
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,187,762	17,013,454
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	19,187,762	17,013,454
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,246,720	13,947,681
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	28,246,720	13,947,681
分配金	1	37,366,818
期末剰余金又は期末欠損金 ()	112,202,255	130,745,650

(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29年7月4日	至 平成30年1月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。	
	特定期間末日 平成30年1月3日が休日のため、当特定期間末日を平成30年1月4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29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
1. 1期首元本額	1,137,589,535円	1,266,289,181円
期中追加設定元本額	366,240,447円	158,797,555円
期中一部解約元本額	237,540,801円	186,961,508円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,266,289,181口	1,238,125,228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112,202,255円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は130,745,650円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日

1 分配金の計算過程	<p>(自平成29年1月5日 至平成29年2月3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(4,540,629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(74,764,165円)及び分配準備積立金(17,812,888円)より分配対象額は97,117,682円(1万口当たり763.97円)であり、うち6,356,102円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年7月4日 至平成29年8月3日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,388,675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(72,217,612円)及び分配準備積立金(3,466,752円)より分配対象額は79,073,039円(1万口当たり656.11円)であり、うち6,025,903円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>
	<p>(自平成29年2月4日 至平成29年3月3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(5,307,637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(78,705,215円)及び分配準備積立金(15,930,575円)より分配対象額は99,943,427円(1万口当たり754.17円)であり、うち6,626,011円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年8月4日 至平成29年9月4日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,608,597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(73,692,099円)及び分配準備積立金(806,356円)より分配対象額は78,107,052円(1万口当たり636.28円)であり、うち6,137,835円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>
	<p>(自平成29年3月4日 至平成29年4月3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(4,166,996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(72,813,737円)及び分配準備積立金(13,484,861円)より分配対象額は90,465,594円(1万口当たり738.18円)であり、うち6,127,623円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年9月5日 至平成29年10月3日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,267,760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(75,983,891円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は79,251,651円(1万口当たり611.88円)であり、うち6,476,128円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>

<p>（自平成29年4月4日 至平成29年5月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,738,025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（74,869,655円）及び分配準備積立金（11,471,134円）より分配対象額は90,078,814円（1万口当たり718.25円）であり、うち6,270,676円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年10月4日 至平成29年11月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,198,514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（70,599,047円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は73,797,561円（1万口当たり587.58円）であり、うち6,279,834円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年5月9日 至平成29年6月5日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,786,394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（75,432,086円）及び分配準備積立金（8,885,638円）より分配対象額は88,104,118円（1万口当たり698.28円）であり、うち6,308,674円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年11月7日 至平成29年12月4日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,082,904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（67,275,944円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は70,358,848円（1万口当たり562.29円）であり、うち6,256,492円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年6月6日 至平成29年7月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,742,217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（75,851,052円）及び分配準備積立金（6,248,340円）より分配対象額は85,841,609円（1万口当たり677.90円）であり、うち6,331,445円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年12月5日 至平成30年1月4日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,057,251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（63,427,580円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は66,484,831円（1万口当たり536.98円）であり、うち6,190,626円（1万口当たり50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29年7月4日 至 平成30年1月4日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成30年1月4日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成29年7月3日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成30年1月4日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	8,104,480	2,246,026
親投資信託受益証券	0	0
合計	8,104,480	2,246,026

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成29年7月3日現在	平成30年1月4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29年7月4日 至 平成30年1月4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29年7月3日現在	当 期 平成30年1月4日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9114円 (9,114円)	0.8944円 (8,944円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-JPY CLASS	11,862,040.540	1,094,463,032	
投資信託受益証券 合計			1,094,463,032	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	998	1,002	
親投資信託受益証券 合計			1,002	
合計			1,094,464,034	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド 日本円・クラス」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

[次へ](#)

「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド
日本円・クラス」の状況

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

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（米ドル建て）

貸借対照表

2016年12月30日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$166,383,724）	\$	164,223,234
外国通貨の評価額（簿価 \$585,721）		580,060
外国為替先渡契約による評価益		5,183,761
先物取引による評価益		94,460
未収：		
利息		3,068,956
デリバティブ取引に係る未収証拠金		280,061
資産合計		173,430,532

負債

保管会社に対する支払		196,715
外国為替先渡契約による評価損		304,950
未払：		
償還済み受益証券		1,731,899
運用会社報酬		85,604
専門家報酬		55,749
保管会社報酬		31,589
会計および管理会社報酬		31,085
名義書換代理人報酬		5,200
受託会社報酬		4,446
為替取引執行会社報酬		3,160
為替運用会社報酬		3,039
その他負債		600
負債合計		2,454,036

純資産

	\$	170,976,496
Class A - 日本円・クラス	\$	8,834,906
Class B - ブラジル・リアル・クラス		98,408,673
Class C - アジア通貨・クラス		14,334,743
Class D - 米ドル・クラス		49,398,174
	\$	170,976,496

発行済み受益証券数

Class A - 日本円・クラス		11,277,169
Class B - ブラジル・リアル・クラス		192,526,064
Class C - アジア通貨・クラス		17,712,824
Class D - 米ドル・クラス		332,897

1口当りの純資産

Class A - 日本円・クラス	\$	0.783
Class B - ブラジル・レアル・クラス	\$	0.511
Class C - アジア通貨・クラス	\$	0.809
Class D - 米ドル・クラス	\$	148.389

損益計算書

2016年12月30日に終了した会計年度

投資収益

受取利息	\$	12,022,339
投資収益合計		12,022,339

費用

運用会社報酬	1,004,524
保管会社報酬	112,931
会計および管理会社報酬	109,783
専門家報酬	60,537
為替運用会社報酬	38,293
名義書換代理人報酬	21,160
受託会社報酬	16,750
為替取引執行会社報酬	12,708
その他費用	12,422
費用合計	1,389,108

投資純利益	10,633,231
--------------	-------------------

実現利益（損失）および評価益（損）：**実現利益（損失）：**

証券投資	353,263
先物取引	(198,373)
スワップ契約	59,016
外国為替取引および外国為替先渡契約	20,896,742
純実現利益	21,110,648

評価益（損）の純変動：

証券投資	10,260,337
スワップ契約	(73,945)
先物取引	94,460
外国為替換算および外国為替先渡契約	10,274,006
評価益の純変動	20,554,858

純実現・純評価益	41,665,506
-----------------	-------------------

運用による純資産の純増	\$ 52,298,737
--------------------	----------------------

投資明細表

2016年12月30日

元本 有価証券の明細評価額

債券 (95.6%)**オーストラリア (1.6%)****社債 (1.6%)**

Australia & New Zealand Banking Group, Ltd.

USD	875,000	6.75% due 12/29/49 (a)(b)	\$	924,548
-----	---------	---------------------------	----	---------

QBE Insurance Group, Ltd.

USD	1,025,000	5.88% due 06/17/46 (a)(c)		1,029,774
-----	-----------	---------------------------	--	-----------

Virgin Australia Holdings, Ltd.

USD	750,000	7.88% due 10/15/21 (d)		753,750
-----	---------	------------------------	--	---------

社債合計**2,708,072****オーストラリア合計 (簿価 \$2,700,469)****2,708,072****バングラデシュ (1.1%)****社債 (1.1%)**

Banglalink Digital Communications, Ltd.

USD	1,700,000	8.63% due 05/06/19 (c)		1,795,540
-----	-----------	------------------------	--	-----------

社債合計**1,795,540****バングラデシュ合計 (簿価 \$1,712,204)****1,795,540****中国 (29.2%)****社債 (29.2%)**

361 Degrees International, Ltd.

USD	200,000	7.25% due 06/03/21 (c)		212,458
-----	---------	------------------------	--	---------

Anton Oilfield Services Group

USD	400,000	7.50% due 11/06/18		344,000
-----	---------	--------------------	--	---------

Baoxin Auto Finance I, Ltd.

USD	2,000,000	8.75% due 12/29/49 (a)(b)(c)		2,011,230
-----	-----------	------------------------------	--	-----------

BCP Singapore VI Cayman Financing Co., Ltd.

USD	1,300,000	8.00% due 04/15/21 (c)(d)		1,274,000
-----	-----------	---------------------------	--	-----------

USD	1,900,000	8.00% due 04/15/21 (c)		1,862,000
-----	-----------	------------------------	--	-----------

Biostime International Holdings, Ltd.

USD	800,000	7.25% due 06/21/21		837,829
-----	---------	--------------------	--	---------

Caifu Holdings, Ltd.

USD	500,000	8.75% due 01/24/20 (c)		521,250
-----	---------	------------------------	--	---------

CAR, Inc.

USD	1,500,000	6.13% due 02/04/20 (c)		1,561,247
-----	-----------	------------------------	--	-----------

Central China Real Estate, Ltd.

USD	400,000	6.50% due 06/04/18 (c)		405,560
-----	---------	------------------------	--	---------

USD	500,000	6.75% due 11/08/21		499,275
-----	---------	--------------------	--	---------

USD	900,000	8.00% due 01/28/20 (c)		937,153
-----	---------	------------------------	--	---------

USD	225,000	8.75% due 01/23/21 (c)		240,210
-----	---------	------------------------	--	---------

China Aoyuan Property Group, Ltd.

USD	800,000	11.25% due 01/17/19 (c)		851,134
-----	---------	-------------------------	--	---------

China Evergrande Group

USD	800,000	8.75% due 10/30/18		814,000
-----	---------	--------------------	--	---------

China Shanshui Cement Group, Ltd.

USD	1,300,000	7.50% due 03/10/20 (c)		1,031,810
-----	-----------	------------------------	--	-----------

CIFL Holdings Group Co., Ltd.

USD	600,000	7.75% due 06/05/20		641,705
-----	---------	--------------------	--	---------

USD	700,000	8.88% due 01/27/19 (c)		735,104
-----	---------	------------------------	--	---------

Country Garden Holdings Co., Ltd.

USD	750,000	7.25% due 04/04/21		787,720
-----	---------	--------------------	--	---------

USD	900,000	7.88% due 05/27/19 ^(c) eHi Car Services, Ltd.	948,232
USD	1,300,000	7.50% due 12/08/18 Future Land Development Holdings, Ltd.	1,368,250
USD	600,000	6.25% due 11/12/17	609,352
USD	400,000	10.25% due 07/21/19 ^(c) Golden Eagle Retail Group, Ltd.	431,854
USD	1,000,000	4.63% due 05/21/23 Haichuan International Investment Co., Ltd.	855,000
USD	900,000	5.35% due 09/29/19 KWG Property Holding, Ltd.	894,377
USD	1,625,000	8.25% due 08/05/19 ^(c)	1,723,719
USD	1,100,000	8.98% due 01/14/19 ^(c) Logan Property Holdings Co., Ltd.	1,150,881
USD	700,000	11.25% due 06/04/19 ^(c) Maoye International Holdings, Ltd.	761,971
USD	1,400,000	7.75% due 05/19/17 Modern Land China Co., Ltd.	1,399,440
USD	1,300,000	6.88% due 10/20/19	1,265,556
USD	300,000	12.75% due 07/31/19 ^(c) Moon Wise Global, Ltd.	328,391
USD	3,500,000	9.00% due 01/29/49 ^{(a)(b)(c)} Oceanwide Holdings International 2015 Co., Ltd.	3,794,539
USD	400,000	9.63% due 08/11/20 Oceanwide Real Estate International Holdings Co., Ltd.	436,527
USD	600,000	11.75% due 09/08/19 ^(c) Parkson Retail Group, Ltd.	658,877
USD	1,300,000	4.50% due 05/03/18 Prime Bloom Holdings, Ltd.	1,260,304
USD	2,000,000	7.50% due 12/19/19 Shanxi Road & Bridge Construction Group Co., Ltd.	1,981,430
USD	500,000	4.85% due 11/04/19 Shui On Development Holding, Ltd.	488,657
USD	550,000	8.70% due 05/19/18 Sparkle Assets, Ltd.	579,879
USD	750,000	6.88% due 01/30/20 ^(c) Times Property Holdings, Ltd.	776,911
CNH	4,500,000	10.38% due 07/16/17	657,243
USD	400,000	12.63% due 03/21/19 ^(c) Trillion Chance, Ltd.	433,513
USD	1,500,000	8.50% due 01/10/19 ^(c) West China Cement, Ltd.	1,560,000
USD	1,500,000	6.50% due 09/11/19 ^(c) Xiangyu Investment BVI Co., Ltd.	1,560,981
USD	1,000,000	4.75% due 07/14/19 Xinyuan Real Estate Co., Ltd.	996,807
USD	1,200,000	8.13% due 08/30/19 Yestar International Holdings Co., Ltd.	1,156,490
USD	300,000	6.90% due 09/15/21 ^(c) Yingde Gases Investment, Ltd.	306,323
USD	1,300,000	7.25% due 02/28/20 ^(c)	970,802

USD	800,000	8.13% due 04/22/18 Yuzhou Properties Co., Ltd.	712,000
USD	1,200,000	8.63% due 01/24/19 ^(c) Zhiyuan Group BVI Co., Ltd.	1,253,791
USD	1,500,000	6.20% due 01/11/19 Zhongrong International Bond 2015, Ltd.	1,527,448
USD	1,000,000	6.00% due 06/15/18 Zhongrong International Bond 2016, Ltd.	1,009,572
USD	400,000	6.95% due 06/21/19	409,817
		社債合計	49,836,619
		中国合計 (簿価 \$49,458,551)	49,836,619
		香港 (17.7%)	
		社債 (17.7%)	
		Bank of East Asia, Ltd.	
USD	1,790,000	5.50% due 12/29/49 ^{(a)(b)} Bank of East Asia, Ltd.	1,714,197
USD	2,050,000	8.50% due 11/29/49 ^{(a)(b)(c)} China CITIC Bank International, Ltd.	2,309,856
USD	900,000	7.25% due 04/29/49 ^{(a)(b)(c)} China High Speed Transmission Equipment Group Co., Ltd.	943,650
CNY	1,500,000	8.30% due 11/19/17 Chinalco Capital Holdings, Ltd.	216,922
USD	3,550,000	4.00% due 08/25/21 Chong Hing Bank, Ltd.	3,487,041
USD	1,100,000	6.50% due 09/29/49 ^{(a)(b)(c)} Industrial & Commercial Bank of China Asia, Ltd.	1,130,440
USD	3,700,000	4.25% due 12/29/49 ^{(a)(b)} IT, Ltd.	3,555,974
CNH	5,100,000	6.25% due 05/15/18 Li & Fung, Ltd.	713,763
USD	1,900,000	5.25% due 12/29/49 ^(b) MCE Finance, Ltd.	1,648,453
USD	500,000	5.00% due 02/15/21 ^{(c)(d)}	496,815
USD	1,050,000	5.00% due 02/15/21 ^(c) MIE Holdings Corp.	1,043,310
USD	700,000	6.88% due 02/06/18 ^(c)	581,396
USD	1,000,000	7.50% due 04/25/19 NWD Finance BVI, Ltd.	702,966
USD	1,400,000	5.75% due 12/29/49 ^(b) RKI Overseas Finance 2016 A, Ltd.	1,378,664
USD	1,800,000	5.00% due 08/09/19 Shimao Property Holdings, Ltd.	1,811,425
USD	1,000,000	6.63% due 01/14/20 ^(c)	1,033,056
USD	1,000,000	8.38% due 02/10/22 ^(c) Studio City Co., Ltd.	1,115,121
USD	850,000	7.25% due 11/30/21 Studio City Finance, Ltd.	879,750
USD	3,400,000	8.50% due 12/01/20 ^{(c)(d)} Texhong Textile Group, Ltd.	3,527,500
USD	400,000	6.50% due 01/18/19 ^(c)	411,000

		Zoomlion HK SPV Co., Ltd.	
USD	1,700,000	6.13% due 12/20/22	1,627,750
		社債合計	30,329,049
		香港合計 (簿価 \$31,026,820)	30,329,049
		インド (8.4%)	
		社債 (8.4%)	
		Adani Transmission, Ltd.	
USD	800,000	4.00% due 08/03/26	755,421
		Century, Ltd.	
USD	700,000	10.25% due 11/12/19 ^(c)	735,624
		Delhi International Airport Pvt, Ltd.	
USD	600,000	6.13% due 02/03/22	636,638
USD	1,200,000	6.13% due 10/31/26	1,237,245
		GCX, Ltd.	
USD	1,000,000	7.00% due 08/01/19	991,625
		Glenmark Pharmaceuticals, Ltd.	
USD	1,100,000	4.50% due 08/02/21	1,094,409
		Greenko Investment Co.	
USD	2,800,000	4.88% due 08/16/23	2,635,869
		ICICI Bank, Ltd.	
USD	1,300,000	6.38% due 04/30/22 ^{(a)(c)}	1,303,202
		Lodha Developers International, Ltd.	
USD	800,000	12.00% due 03/13/20 ^(c)	760,000
		State Bank of India	
USD	2,600,000	6.44% due 11/29/49 ^{(a)(b)(c)}	2,602,322
USD	400,000	7.14% due 06/29/49 ^{(a)(b)(c)}	401,522
		Tata Motors, Ltd.	
USD	700,000	5.75% due 10/30/24	736,190
		Vedanta Resources PLC	
USD	400,000	7.13% due 05/31/23	390,500
		社債合計	14,280,567
		インド合計 (簿価 \$14,178,222)	14,280,567
		インドネシア (3.5%)	
		社債 (3.5%)	
		Gajah Tunggal Tbk PT	
USD	700,000	7.75% due 02/06/18	619,430
		Majapahit Holding BV	
USD	1,500,000	7.75% due 01/20/20	1,683,750
USD	1,000,000	7.88% due 06/29/37	1,181,300
		Perusahaan Listrik Negara PT	
USD	600,000	5.25% due 10/24/42	529,500
		Star Energy Geothermal Wayang Windu, Ltd.	
USD	2,000,000	6.13% due 03/27/20	2,040,000
		社債合計	6,053,980
		インドネシア合計 (簿価 \$6,011,875)	6,053,980
		ルクセンブルク (2.3%)	
		社債 (2.3%)	
		Puma International Financing S.A.	
USD	1,300,000	6.75% due 02/01/21 ^{(c)(d)}	1,337,622
USD	2,500,000	6.75% due 02/01/21 ^(c)	2,572,350
		社債合計	3,909,972
		ルクセンブルク合計 (簿価 \$3,784,911)	3,909,972

マカオ (1.9%)			
社債 (1.9%)			
Wynn Macau, Ltd.			
USD	3,300,000	5.25% due 10/15/21 ^{(c)(d)}	3,324,750
社債合計			3,324,750
マカオ合計 (簿価 \$3,345,005)			3,324,750
モンゴル (0.1%)			
国債 (0.1%)			
Mongolia Government International Bond			
USD	200,000	4.13% due 01/05/18	193,500
国債合計			193,500
モンゴル合計 (簿価 \$192,868)			193,500
オランダ (4.7%)			
社債 (4.7%)			
Greenko Dutch BV			
USD	1,200,000	8.00% due 08/01/19	1,266,600
Indo Energy Finance II BV			
USD	2,100,000	6.38% due 01/24/23	1,511,624
Jababeka International BV			
USD	900,000	6.50% due 10/05/23	879,279
Listrindo Capital BV			
USD	1,500,000	4.95% due 09/14/26	1,462,610
Majapahit Holding BV			
USD	500,000	7.88% due 06/29/37	590,650
USD	800,000	8.00% due 08/07/19	896,000
Royal Capital BV			
USD	1,000,000	4.88% due 12/29/49 ^{(a)(b)}	924,059
Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV			
USD	500,000	4.88% due 12/16/21	501,900
社債合計			8,032,722
オランダ合計 (簿価 \$8,507,545)			8,032,722
シンガポール (17.2%)			
社債 (17.2%)			
ABJA Investment Co. Pte, Ltd.			
USD	4,750,000	5.95% due 07/31/24	4,645,937
Alam Synergy Pte, Ltd.			
USD	750,000	6.63% due 04/24/22	734,751
USD	300,000	6.95% due 03/27/20	304,500
Bakrie Telecom Pte, Ltd.			
USD	2,600,000	11.50% due 05/11/17 ^(e)	26,000
BW Group, Ltd.			
USD	900,000	6.63% due 06/28/17	910,080
DBS Group Holdings, Ltd.			
USD	450,000	3.60% due 12/29/49 ^{(a)(b)}	433,359
Global A&T Electronics, Ltd.			
USD	600,000	10.00% due 02/01/19 ^(d)	456,000
USD	1,700,000	10.00% due 02/01/19	1,292,000
Global Prime Capital Pte, Ltd.			
USD	900,000	5.50% due 10/18/23 ^(c)	905,054
Golden Legacy Pte, Ltd.			
USD	400,000	8.25% due 06/07/21	412,000
Golden Legacy PTE, Ltd.			
USD	2,000,000	9.00% due 04/24/19 ^(c)	2,090,000

		ITNL International Pte, Ltd.	
CNH	4,000,000	8.00% due 07/17/17	565,801
		Jubilant Pharma, Ltd.	
USD	1,200,000	4.88% due 10/06/21	1,168,440
		Marquee Land Pte, Ltd.	
USD	1,200,000	9.75% due 08/05/19 ^(c)	1,275,000
		MPM Global Pte, Ltd.	
USD	900,000	6.75% due 09/19/19 ^(c)	921,451
		Ottawa Holdings Pte, Ltd.	
USD	1,000,000	5.88% due 05/16/18 ^(c)	700,000
		Pacific Emerald Pte, Ltd.	
USD	1,200,000	9.75% due 07/25/18 ^(c)	1,251,600
		Pakuwon Prima Pte, Ltd.	
USD	500,000	7.13% due 07/02/19 ^(c)	524,803
		Pratama Agung Pte, Ltd.	
USD	4,200,000	6.25% due 02/24/20 ^(c)	4,345,606
		STATS ChipPAC Pte, Ltd.	
USD	2,300,000	8.50% due 11/24/20	2,392,000
		STATS ChipPAC, Ltd.	
USD	200,000	4.50% due 03/20/18 ^(c)	195,000
		TBG Global Pte, Ltd.	
USD	250,000	4.63% due 04/03/18 ^(c)	252,250
USD	500,000	4.63% due 04/03/18 ^(c)	504,500
		TBG Global Pte, Ltd.	
USD	1,400,000	5.25% due 02/10/22 ^(c)	1,396,091
		Theta Capital Pte, Ltd.	
USD	800,000	6.75% due 10/31/26	745,818
		Theta Capital Pte, Ltd.	
USD	875,000	7.00% due 04/11/22 ^(c)	896,640
		社債合計	29,344,681
		シンガポール合計 (簿価 \$32,339,238)	29,344,681
		韓国 (0.6%)	
		社債 (0.6%)	
		SK E&S Co., Ltd.	
USD	1,000,000	4.88% due 11/29/49 ^{(a)(b)}	980,000
		社債合計	980,000
		韓国合計 (簿価 \$1,002,692)	980,000
		スリランカ (1.8%)	
		社債 (1.8%)	
		National Savings Bank	
USD	2,900,000	8.88% due 09/18/18	3,063,125
		社債合計	3,063,125
		スリランカ合計 (簿価 \$3,011,031)	3,063,125
		英国 (4.5%)	
		社債 (4.5%)	
		HSBC Holdings PLC	
USD	2,000,000	6.38% due 12/29/49 ^{(a)(b)(c)}	1,990,000
		Jaguar Land Rover Automotive PLC	
USD	600,000	5.63% due 02/01/23 ^{(c)(d)}	625,500
		Standard Chartered PLC	

USD	1,800,000	7.50% due 12/29/49 ^{(a)(b)} Vedanta Resources PLC		1,795,500
USD	400,000	6.00% due 01/31/19		401,000
USD	2,800,000	8.25% due 06/07/21		2,913,400
		社債合計		7,725,400
		英国合計 (簿価 \$6,497,839)		7,725,400
		米国 (1.0%)		
		社債 (1.0%)		
		Nexteer Automotive Group, Ltd.		
USD	200,000	5.88% due 11/15/21 ^{(c)(d)}		207,500
USD	700,000	5.88% due 11/15/21 ^(c) Terraform Global Operating LLC		726,250
USD	800,000	9.75% due 08/15/22 ^{(c)(d)}		854,000
		社債合計		1,787,750
		米国合計 (簿価 \$1,756,812)		1,787,750
		債券合計 (簿価 \$165,526,082)		\$ 163,365,727
		短期投資 (0.5%)		
		グランド・ケイマン (0.0%)		
		定期預金 (0.0%)		
		Brown Brothers Harriman & Co.		
EUR	8,349	(0.56)% due 01/02/17 ^(f)		8,806
JPY	4	(0.28)% due 01/04/17 ^(f)		0**
HKD	4,874	0.01% due 01/03/17		629
AUD	4,356	0.76% due 01/03/17		3,154
		定期預金合計		12,589
		グランド・ケイマン合計 (簿価 \$12,724)		12,589
		英国 (0.5%)		
		定期預金 (0.5%)		
		JPMorgan Chase & Co.		
USD	844,918	0.26% due 01/03/17		844,918
		定期預金合計		844,918
		英国合計 (簿価 \$844,918)		844,918
		短期投資合計 (簿価 \$857,642)		857,507
		投資総額 (簿価 \$166,383,724)	96.1	\$ 164,223,234
		負債を超過する現金およびその他の資産	3.9	6,753,262
		純資産	100.0%	\$ 170,976,496

2016年12月30日現在の先物取引（純資産の0.1%）

ポジション	明細	限月	枚数	評価益
Long	Australia 10-Year Bond March 2017	2017/3	47	\$ 17,049
Long	South Korea 10-Year Bond March 2017	2017/3	54	52,310
Short	US 5-Year Note March 2017	2017/3	(51)	25,101
				\$ 94,460

2016年12月30日現在のファンドレベルの外国為替先渡契約（純資産の0.0%）

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	純評価益
----	------	------	-----	----	------	------

JPY	Citibank N.A.	16,000,000	2017/1/5	USD	136,228	\$	964
JPY	Citibank N.A.	180,000,000	2017/1/5	USD	1,532,561		10,849
JPY	Citibank N.A.	6,000,000	2017/1/5	USD	51,085		362
						\$	12,175

2016年12月30日現在のクラスA - 日本円・クラスの外国為替先渡契約(純資産の-0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	純評価(損)
JPY	Citibank N.A.	1,038,239,085	2017/1/24	USD	9,127,732	\$ (214,925)
						\$0

2016年12月30日現在のクラスB - ブラジル・レアル・クラスの外国為替先渡契約(純資産の3.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	純評価益
BRL	Citibank N.A.	320,103,428	2017/1/24	USD	92,634,072	\$ 5,171,586

2016年12月30日現在のクラスC - アジア通貨・クラスの外国為替先渡契約(純資産の-0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	純評価(損)
CNY	Citibank N.A.	33,612,684	2017/1/24	USD	4,845,033	\$ (12,384)
IDR	Citibank N.A.	64,648,048,366	2017/1/24	USD	4,832,091	(47,300)
IDR	Citibank N.A.	326,742,629	2017/1/24	USD	4,835,044	(30,341)
						\$ (90,025)

(a) 2016年12月30日時点の変動金利証券。

(b) 永久債。

(c) 償還条項付き証券。

(d) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関購入者に転売が可能である。他に指定がない限り、これらの証券は非流動的だとはみなされない。

(e) デフォルトした証券。

(f) 欧州中央銀行による中銀預金金利の引き下げが影響して、ユーロ建ての短期金融商品の金利はゼロ%を下回る可能性もある。

*時価1ドル未満。

通貨の略称

BRL	ブラジル・レアル
CNH	香港(オフショア)で取引される人民元
CNY	人民元
EUR	ユーロ
HKD	香港ドル
IDR	インドネシア・ルピア
INR	インド・ルピー
JPY	日本円
USD	米ドル

[次へ](#)

「ダイワ・マネーポートフォリオ・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29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	124,271,204,387	128,076,591,697
国債証券	490,003,340	-
流動資産合計	124,761,207,727	128,076,591,697
資産合計	124,761,207,727	128,076,591,697
負債の部		
流動負債		
未払金	490,003,340	-
未払解約金	1,369,000,000	-
流動負債合計	1,859,003,340	-
負債合計	1,859,003,340	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 122,313,636,707	127,501,026,239
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	588,567,680	575,565,458
元本等合計	122,902,204,387	128,076,591,697
純資産合計	122,902,204,387	128,076,591,697
負債純資産合計	124,761,207,727	128,076,591,697

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29年7月4日 至 平成30年1月4日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
1. 1 期首	平成29年1月5日	平成29年7月4日
期首元本額	102,787,806,763円	122,313,636,707円
期中追加設定元本額	50,675,428,081円	23,361,363,859円
期中一部解約元本額	31,149,598,137円	18,173,974,327円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワ米ドル・ブルファンド (適格機関投資家専用)	4,107,439,300円	5,144,659,018円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	17,499,682,383円	16,890,565,266円
ダイワ・マネーポートフォリオ (F0Fs用)(適格機関投資家専用)	-円	69,673円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2015-07(為替 ヘッジあり/限定追加型)	995円	995円
通貨選択型 米国リート・ クワトロ(毎月分配型)	159,141円	159,141円
通貨選択型アメリカン・エク イティ・クワトロ(毎月分 配型)	159,141円	159,141円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2015-10(為替 ヘッジあり)	995円	995円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2015-10(為替 ヘッジあり)	995円	995円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2015-12(為替 ヘッジあり)	995円	995円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2016-02(為替 ヘッジあり/限定追加型)	995円	995円
コーポレート・ハイブリッド 証券ファンド2016-08(為替 ヘッジあり/限定追加型)	995円	995円
日本株カムイ A I 戦略ファン ド	-円	59,719,320円
ダイワ J P X 日経400ベア・ ファンド(適格機関投資家専 用)	-円	3,285,486,762円
ダイワユーロベア・ファンド (2倍、非リバランス型)(適 格機関投資家専用)	609,869,463円	2,297,118,764円
ダイワ米ドルベア・ファンド (2倍、非リバランス型)(適 格機関投資家専用)	30,009,526,964円	35,118,078,983円
ダイワ/ロジャーズ国際コモ ディティ™・ファンド	9,393,201円	9,393,201円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)日本円・ コース(毎月分配型)	998円	998円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)ブラジ ル・リアル・コース(毎月分 配型)	998円	998円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)アジア通 貨・コース(毎月分配型)	998円	998円
ダイワ T O P I X ベア・ファ ンド(適格機関投資家専用)	69,671,825,855円	64,694,720,539円

ダイワ豪ドル建て高利回り証券（毎月分配型）	9,949円	9,949円
ダイワ米国国債7 - 10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - USトライアングル -	351,635,806円	703,716円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -	53,926,540円	173,802円
計	122,313,636,707円	127,501,026,239円
2. 期末日における受益権の総数	122,313,636,707口	127,501,026,239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29年7月4日 至 平成30年1月4日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年1月4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	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	0	-
合計	0	-

（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28年12月10日から平成29年7月3日まで、及び平成29年12月12日から平成30年1月4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29年7月3日現在	平成30年1月4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29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
1口当たり純資産額	1.0048円	1.0045円
(1万口当たり純資産額)	(10,048円)	(10,045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

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース
（毎月分配型）

(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29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース
（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期 平成29年7月3日現在		当 期 平成30年1月4日現在	
	金 額（円）		金 額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		307,381,657		224,724,276
投資信託受益証券		10,235,810,520		9,588,570,195
親投資信託受益証券		1,002		1,002
流動資産合計		10,543,193,179		9,813,295,473
資産合計		10,543,193,179		9,813,295,473
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		125,167,462		118,425,798
未払解約金		7,558,461		36,955,900
未払受託者報酬		258,739		271,525
未払委託者報酬		9,056,112		9,503,757
その他未払費用		447,318		429,137
流動負債合計		142,488,092		165,586,117
負債合計		142,488,092		165,586,117
純資産の部				
元本等				
元本	1	15,645,932,772		14,803,224,795
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	5,245,227,685		5,155,515,439
（分配準備積立金）		1,750,416,308		1,417,869,897
元本等合計		10,400,705,087		9,647,709,356
純資産合計		10,400,705,087		9,647,709,356
負債純資産合計		10,543,193,179		9,813,295,473

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	901,231,480	609,532,688
有価証券売買等損益	489,247,275	3,226,987
営業収益合計	411,984,205	612,759,675
営業費用		
支払利息	30,909	42,718
受託者報酬	1,789,578	1,716,855
委託者報酬	62,636,419	60,091,886
その他費用	448,299	429,137
営業費用合計	64,905,205	62,280,596
営業利益	347,079,000	550,479,079
経常利益	347,079,000	550,479,079
当期純利益	347,079,000	550,479,079
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	8,498,046	3,517,051
期首剰余金又は期首欠損金 ()	5,120,796,997	5,245,227,685
剰余金増加額又は欠損金減少額	585,141,356	480,935,094
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	585,141,356	480,935,094
剰余金減少額又は欠損金増加額	284,764,462	208,086,486
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	284,764,462	208,086,486
分配金	1	730,098,390
期末剰余金又は期末欠損金 ()	5,245,227,685	5,155,515,439

(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29年7月4日	至 平成30年1月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。	
	特定期間末日 平成30年1月3日が休日のため、当特定期間末日を平成30年1月4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29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
1. 1 期首元本額	16,652,160,833円	15,645,932,772円
期中追加設定元本額	942,822,400円	683,132,265円
期中一部解約元本額	1,949,050,461円	1,525,840,242円
2. 特定期間末日における受益権の総数	15,645,932,772口	14,803,224,795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5,245,227,685円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,155,515,439円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日

1 分配金の計算過程	<p>(自平成29年1月5日 至平成29年2月3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(151,429,150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(263,453,447円)及び分配準備積立金(1,840,784,164円)より分配対象額は2,255,666,761円(1万口当たり1,380.34円)であり、うち130,730,928円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年7月4日 至平成29年8月3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(117,681,268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(360,978,820円)及び分配準備積立金(1,729,626,899円)より分配対象額は2,208,286,987円(1万口当たり1,416.86円)であり、うち124,686,255円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>
	<p>(自平成29年2月4日 至平成29年3月3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(155,098,536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(265,667,197円)及び分配準備積立金(1,818,959,610円)より分配対象額は2,239,725,343円(1万口当たり1,397.26円)であり、うち128,235,605円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年8月4日 至平成29年9月4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(104,409,190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(366,985,047円)及び分配準備積立金(1,689,686,455円)より分配対象額は2,161,080,692円(1万口当たり1,404.94円)であり、うち123,056,475円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>
	<p>(自平成29年3月4日 至平成29年4月3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(147,904,952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(295,188,112円)及び分配準備積立金(1,803,451,883円)より分配対象額は2,246,544,947円(1万口当たり1,410.64円)であり、うち127,405,357円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年9月5日 至平成29年10月3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(95,313,904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(405,535,475円)及び分配準備積立金(1,639,068,084円)より分配対象額は2,139,917,463円(1万口当たり1,387.91円)であり、うち123,346,158円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>

<p>(自平成29年4月4日 至平成29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(140,797,078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(315,310,406円)及び分配準備積立金(1,793,585,810円)より分配対象額は2,249,693,294円(1万口当たり1,419.51円)であり、うち126,786,654円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年10月4日 至平成29年11月6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(83,804,071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(403,120,750円)及び分配準備積立金(1,571,376,890円)より分配対象額は2,058,301,711円(1万口当たり1,363.51円)であり、うち120,765,168円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成29年5月9日 至平成29年6月5日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(132,206,111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(317,590,819円)及び分配準備積立金(1,776,615,299円)より分配対象額は2,226,412,229円(1万口当たり1,424.19円)であり、うち125,062,530円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年11月7日 至平成29年12月4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(85,445,637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(405,040,588円)及び分配準備積立金(1,517,435,093円)より分配対象額は2,007,921,318円(1万口当たり1,340.64円)であり、うち119,818,536円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成29年6月6日 至平成29年7月3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(118,817,058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(347,727,615円)及び分配準備積立金(1,756,766,712円)より分配対象額は2,223,311,385円(1万口当たり1,421.02円)であり、うち125,167,462円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年12月5日 至平成30年1月4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(72,671,952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(402,533,919円)及び分配準備積立金(1,463,623,743円)より分配対象額は1,938,829,614円(1万口当たり1,309.73円)であり、うち118,425,798円(1万口当たり80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29年7月4日 至 平成30年1月4日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成30年1月4日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	126,734,373	196,702,809
親投資信託受益証券	0	0
合計	126,734,373	196,702,809

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成29年7月3日現在	平成30年1月4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29年7月4日 至 平成30年1月4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29年7月3日現在	当 期 平成30年1月4日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6648円 (6,648円)	0.6517円 (6,517円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-BRL CLASS	168,866,369.550	9,588,570,195	
投資信託受益証券 合計			9,588,570,195	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	998	1,002	
親投資信託受益証券 合計			1,002	
合計			9,588,571,197	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド ブラジル・リアル・クラス」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド ブラジル・リアル・クラス」の状況

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）

(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29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	平成29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,492,410	53,392,009
投資信託受益証券	1,716,487,901	2,278,528,328
親投資信託受益証券	1,002	1,002
未収入金	-	20,000,000
流動資産合計	1,757,981,313	2,351,921,339
資産合計	1,757,981,313	2,351,921,339
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,230,004	20,162,163
未払解約金	3,317,150	29,821,041
未払受託者報酬	42,782	63,425
未払委託者報酬	1,497,690	2,220,008
その他未払費用	68,096	85,247
流動負債合計	20,155,722	52,351,884
負債合計	20,155,722	52,351,884
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,692,222,700	2,240,240,386
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	45,602,891	59,329,069
(分配準備積立金)	291,057,559	241,575,609
元本等合計	1,737,825,591	2,299,569,455
純資産合計	1,737,825,591	2,299,569,455
負債純資産合計	1,757,981,313	2,351,921,339

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	91,627,246	98,651,781
有価証券売買等損益	2,070,491	23,388,646
営業収益合計	89,556,755	122,040,427
営業費用		
支払利息	5,084	10,781
受託者報酬	272,742	341,359
委託者報酬	9,547,782	11,948,913
その他費用	68,262	85,247
営業費用合計	9,893,870	12,386,300
営業利益	79,662,885	109,654,127
経常利益	79,662,885	109,654,127
当期純利益	79,662,885	109,654,127
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	29,930	698,416
期首剰余金又は期首欠損金 ()	53,299,386	45,602,891
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,641,177	23,236,269
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,641,177	23,236,269
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,408,782	6,495,635
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,408,782	6,495,635
分配金	1	89,561,845
111,970,167		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	45,602,891	59,329,069

(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29年7月4日	至 平成30年1月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。	
	特定期間末日 平成30年1月3日が休日のため、当特定期間末日を平成30年1月4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29年7月3日現在	平成30年1月4日現在
1. 1期首元本額	1,626,721,252円	1,692,222,700円
期中追加設定元本額	157,561,990円	764,685,314円
期中一部解約元本額	92,060,542円	216,667,628円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,692,222,700口	2,240,240,386口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成29年1月5日 至 平成29年7月3日	自 平成29年7月4日 至 平成30年1月4日

1 分配金の計算過程	<p>（自平成29年1月5日 至平成29年2月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,400,715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（133,822,827円）及び分配準備積立金（310,715,854円）より分配対象額は458,939,396円（1万口当たり2,811.20円）であり、うち14,692,844円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年7月4日 至平成29年8月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,124,433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（187,815,576円）及び分配準備積立金（290,168,399円）より分配対象額は491,108,408円（1万口当たり2,770.05円）であり、うち15,956,279円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年2月4日 至平成29年3月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,049,457円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（138,858,512円）及び分配準備積立金（306,025,524円）より分配対象額は459,933,493円（1万口当たり2,813.38円）であり、うち14,713,293円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年8月4日 至平成29年9月4日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,308,816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（212,945,122円）及び分配準備積立金（285,689,046円）より分配対象額は512,942,984円（1万口当たり2,758.93円）であり、うち16,732,882円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年3月4日 至平成29年4月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,957,519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（151,883,827円）及び分配準備積立金（304,800,831円）より分配対象額は470,642,177円（1万口当たり2,806.61円）であり、うち15,092,144円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年9月5日 至平成29年10月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,297,074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（292,708,473円）及び分配準備積立金（275,790,916円）より分配対象額は582,796,463円（1万口当たり2,743.47円）であり、うち19,118,732円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>

<p>（自平成29年4月4日 至平成29年5月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,263,814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（150,796,738円）及び分配準備積立金（300,072,148円）より分配対象額は465,132,700円（1万口当たり2,802.61円）であり、うち14,936,776円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年10月4日 至平成29年11月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,695,816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（325,363,373円）及び分配準備積立金（266,490,523円）より分配対象額は608,549,712円（1万口当たり2,729.94円）であり、うち20,062,545円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年5月9日 至平成29年6月5日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,724,174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（153,227,543円）及び分配準備積立金（295,797,686円）より分配対象額は461,749,403円（1万口当たり2,789.69円）であり、うち14,896,784円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年11月7日 至平成29年12月4日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,217,646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（331,303,262円）及び分配準備積立金（253,722,940円）より分配対象額は600,243,848円（1万口当たり2,709.56円）であり、うち19,937,566円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年6月6日 至平成29年7月3日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,948,465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（164,675,885円）及び分配準備積立金（292,339,098円）より分配対象額は470,963,448円（1万口当たり2,783.11円）であり、うち15,230,004円（1万口当たり90円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年12月5日 至平成30年1月4日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,282,315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（341,659,122円）及び分配準備積立金（245,455,457円）より分配対象額は603,396,894円（1万口当たり2,693.45円）であり、うち20,162,163円（1万口当たり90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29年7月4日 至 平成30年1月4日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成30年1月4日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成29年7月3日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成30年1月4日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	16,220,308	9,732,538
親投資信託受益証券	0	0
合計	16,220,308	9,732,538

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成29年7月3日現在	平成30年1月4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29年7月4日 至 平成30年1月4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29年7月3日現在	当 期 平成30年1月4日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0269円 (10,269円)	1.0265円 (10,265円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	ASIA HIGH YIELD BOND FUND-ACC CLASS	23,944,936.560	2,278,528,328	
投資信託受益証券 合計			2,278,528,328	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	998	1,002	
親投資信託受益証券 合計			1,002	
合計			2,278,529,330	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド アジア通貨・クラス」受益証券(円建)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・グローバル・トラスト - ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド アジア通貨・クラス」の状況

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）

【純資産額計算書】

平成30年1月31日

資産総額	1,086,503,341円
負債総額	957,029円
純資産総額（ - ）	1,085,546,312円
発行済数量	1,213,223,567口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8948円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	128,241,828,451円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	128,241,828,451円
発行済数量	127,670,316,435口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0045円

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	9,678,590,752円
負債総額	28,606,488円
純資産総額（ - ）	9,649,984,264円
発行済数量	14,645,171,859口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6589円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	2,294,753,786円
負債総額	2,018,270円
純資産総額（ - ）	2,292,735,516円
発行済数量	2,274,943,339口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0078円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年1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	80	207,244
追加型株式投資信託	711	15,353,435
株式投資信託 合計	791	15,560,678
単位型公社債投資信託	24	121,006
追加型公社債投資信託	14	1,645,387
公社債投資信託 合計	38	1,766,394
総合計	829	17,327,072

3 【委託会社等の経理状況】

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

<訂正後>

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

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58期事業年度（平成28年4月1日から平成29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59期事業年度に係る中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	229
建物	18	15
器具備品	224	214

無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	4,946
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
固定負債		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254

純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13

その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531
賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305

特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,428	13,428	13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	166	166	166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	422	422	422
当期変動額合計	422	422	589

当期末残高	280	280	41,284
-------	-----	-----	--------

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「有価証券償還益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

（追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）」を当期から適用しております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金	4,320百万円	4,877百万円

3 保証債務

前事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成29年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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

(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28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	13,262百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,084円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は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28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	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

(*) 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29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	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	4,453	4,453	-
(2) その他未払金	4,946	4,946	-
(3) 未払費用(*)	3,409	3,409	-
負債計	12,809	12,809	-

(*) 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)

(1) 其他有価証券 非上場株式	1,021	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,049	1,050

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28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	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

(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28年3月31日)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

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

2. 其他有価証券

前事業年度（平成28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	141	55	86
（2）その他			
証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

（注）非上場株式（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。

当事業年度（平成29年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	122	55	67
（2）その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「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27年4月1日 至 平成28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	3	-	0
（2）その他			
証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	120	122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

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

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,209百万円	2,318百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318

退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,209	2,318

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	222百万円	202百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

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173百万円であります。

(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28年3月31日)	(平成29年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引(譲渡損)	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	347	201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,086	639
その他有価証券評価差額金	124	146
繰延税金負債合計	2,210	786
繰延税金資産の純額	941	470

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

[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27年4月1日 至 平成28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)	1,749	-	-

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28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	--------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	-----------------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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27年4月1日 至 平成28年3月31日）		当事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,826.85円	1株当たり純資産額	15,158.25円
1株当たり当期純利益	5,084.10円	1株当たり当期純利益	4,421.51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27年4月1日 至 平成28年3月31日）	当事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
当期純利益（百万円）	13,262	11,533
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29年9月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,206
有価証券	98
未収委託者報酬	11,259
繰延税金資産	391
その他	278
流動資産合計	34,233
固定資産	
有形固定資産	1 231
無形固定資産	
ソフトウェア	2,066
その他	446
無形固定資産合計	2,512

投資その他の資産	
投資有価証券	6,874
関係会社株式	5,129
その他	1,262
投資その他の資産合計	13,266
固定資産合計	16,010
資産合計	50,244

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成29年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		7,070
未払費用		3,973
未払法人税等		916
賞与引当金		692
その他	2	606
流動負債合計		13,260

固定負債

退職給付引当金		2,324
役員退職慰労引当金		134
繰延税金負債		21
その他		6
固定負債合計		2,487

負債合計

15,747

純資産の部

株主資本

資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金

利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		7,116

利益剰余金合計	7,490
株主資本合計	34,160
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	336
評価・換算差額等合計	336
純資産合計	34,496
負債・純資産合計	50,244

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成29年4月1日	
	至 平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		40,996
その他営業収益		364
営業収益合計		41,360
営業費用		
支払手数料		20,216
その他営業費用		6,325
営業費用合計		26,542
一般管理費	1	5,665
営業利益		9,152
営業外収益	2	222
営業外費用		9
経常利益		9,365
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		9,365
法人税、住民税及び事業税		2,879
法人税等調整額		69
中間純利益		6,416

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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	12,231	12,606	39,276
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
中間純利益	-	-	-	6,416	6,416	6,416
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	-	-	-	5,115	5,115	5,115
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,116	7,490	34,160

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
中間純利益	-	-	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	72	72	72
当中間期変動額合計	72	72	5,043
当中間期末残高	336	336	34,496

注記事項

（重要な会計方針）

- 1．有価証券の評価基準及び評価方法
 - (1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) 其他有価証券

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。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(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29年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間（平成29年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,744百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	471百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
受取配当金	49百万円
投資有価証券売却益	134百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成29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	22,206	22,206	-
(2) 未収委託者報酬	11,259	11,259	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,002	6,002	-
資産合計	39,467	39,467	-
(1) 未払金(*)	7,002	7,002	-
(2) 未払費用(*)	3,424	3,424	-
負債合計	10,427	10,427	-

(*) 金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	5,129
差入保証金	1,044

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29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	124	55	69
(2) その他			
証券投資信託	4,458	3,979	479
小計	4,582	4,034	548
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	1,419	1,482	63
小計	1,419	1,482	63
合計	6,002	5,517	485

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29年9月30日)
--

1株当たり純資産額	13,224.69円
1株当たり中間純利益金額	2,459.79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おりません。

(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29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,416
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,416
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】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

<略>

独立監査人の監査報告書

平成30年2月9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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）の平成29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）の平成30年1月4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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年2月9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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）の平成29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）の平成30年1月4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。

(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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年2月9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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）の平成29年7月4日から平成30年1月4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/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）の平成30年1月4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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年 5月26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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58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29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。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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な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29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29年4月1日から平成29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。