

【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6月20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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）
ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）
（総称を「ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド」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20兆円を上限とします。

【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12月20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】

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（2018年4月末日現在）>

<略>

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

<略>

上記の運用体制は2018年4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>



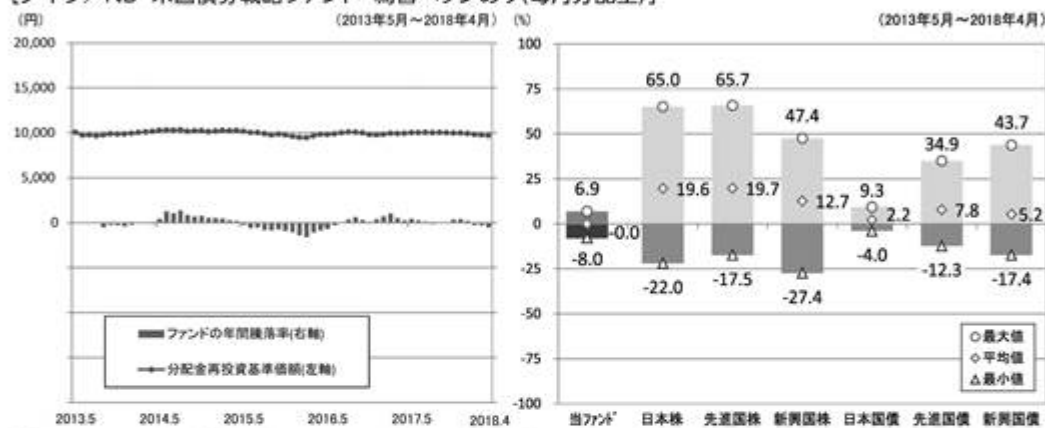
参考情報

- 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年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

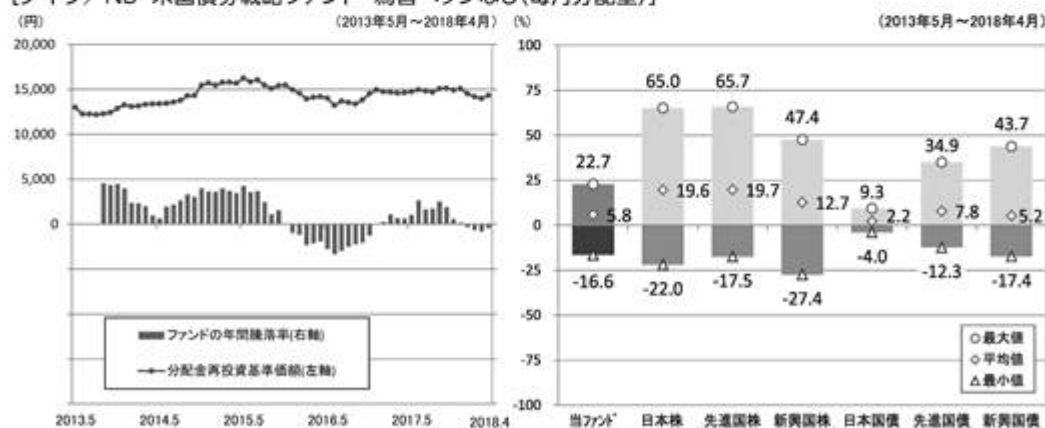
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

【ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)】



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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 更新後 >

< 略 >

() 上記は、2018年4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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）】

(1) 【投資状況】（平成30年4月27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	1,025,159,826	99.06
内 ケイマン諸島	1,025,159,826	99.06
親投資信託受益証券	1,235	0.00
内 日本	1,235	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,704,373	0.94
純資産総額	1,034,865,434	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4月27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	NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED CLASS	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	12,193,976.83	84.44 1,029,764,925	84.07 1,025,159,826	99.06
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	1,235	1.0007 1,235	1.0006 1,235	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	99.06%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.06%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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25年3月27日)	6,796,564,443	6,803,354,739	1.0009	1.0019
第2特定期間末 (平成25年9月27日)	5,895,631,994	5,901,742,002	0.9649	0.9659
第3特定期間末 (平成26年3月27日)	3,895,669,833	3,899,609,732	0.9888	0.9898
第4特定期間末 (平成26年9月29日)	3,216,882,640	3,220,112,435	0.9960	0.9970
第5特定期間末 (平成27年3月27日)	2,819,406,677	2,822,248,425	0.9921	0.9931
第6特定期間末 (平成27年9月28日)	2,410,080,953	2,412,625,592	0.9471	0.9481
第7特定期間末 (平成28年3月28日)	2,051,519,509	2,053,737,451	0.9250	0.9260
第8特定期間末 (平成28年9月27日)	1,666,416,596	1,668,161,474	0.9550	0.9560
第9特定期間末 (平成29年3月27日)	1,422,519,870	1,424,037,235	0.9375	0.9385
平成29年4月末日	1,347,752,229	-	0.9395	-
5月末日	1,333,475,365	-	0.9454	-
6月末日	1,234,565,263	-	0.9438	-
7月末日	1,228,982,322	-	0.9469	-
8月末日	1,189,677,690	-	0.9425	-
第10特定期間末 (平成29年9月27日)	1,174,963,245	1,176,207,982	0.9439	0.9449
9月末日	1,169,154,032	-	0.9429	-
10月末日	1,154,918,762	-	0.9393	-
11月末日	1,121,576,610	-	0.9354	-
12月末日	1,109,131,924	-	0.9343	-
平成30年1月末日	1,091,301,764	-	0.9293	-
2月末日	1,074,145,023	-	0.9176	-
第11特定期間末 (平成30年3月27日)	1,055,466,056	1,056,626,749	0.9093	0.9103
3月末日	1,058,747,531	-	0.9120	-
4月末日	1,034,865,434	-	0.9050	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0050
第2特定期間	0.0060
第3特定期間	0.0060
第4特定期間	0.0060
第5特定期間	0.0060
第6特定期間	0.0060
第7特定期間	0.0060
第8特定期間	0.0060
第9特定期間	0.0060
第10特定期間	0.0060
第11特定期間	0.0060

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	0.6
第2特定期間	3.0
第3特定期間	3.1
第4特定期間	1.3
第5特定期間	0.2
第6特定期間	3.9
第7特定期間	1.7
第8特定期間	3.9
第9特定期間	1.2
第10特定期間	1.3
第11特定期間	3.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	1,949,701,229	991,116,932
第2特定期間	392,211,479	1,072,499,266
第3特定期間	27,861,292	2,197,970,246
第4特定期間	38,233,346	748,337,544
第5特定期間	19,754,443	407,801,449
第6特定期間	5,619,949	302,729,003
第7特定期間	14,793,425	341,490,043
第8特定期間	7,965,945	481,030,031
第9特定期間	3,598,114	231,111,482
第10特定期間	2,909,648	275,537,982
第11特定期間	2,376,709	86,420,171

(注) 当初設定数量は5,831,712,259口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年4月27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)	13,583,602,266	100.00
純資産総額	13,583,602,266	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4月27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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)】

(1) 【投資状況】(平成30年4月27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	278,221,282	99.54
内 ケイマン諸島	278,221,282	99.54
親投資信託受益証券	1,598	0.00
内 日本	1,598	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,281,429	0.46
純資産総額	279,504,309	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4月27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	NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	2,267,935.72	118.26 268,224,309	122.67 278,221,282	99.54
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,598	1.0007 1,599	1.0006 1,598	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	99.54%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.54%

(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25年3月27日)	986,328,338	987,969,755	1.2018	1.2038
第2特定期間末 (平成25年9月27日)	868,035,561	869,466,464	1.2133	1.2153
第3特定期間末 (平成26年3月27日)	727,862,383	728,997,050	1.2830	1.2850
第4特定期間末 (平成26年9月29日)	706,308,805	709,910,759	1.3726	1.3796
第5特定期間末 (平成27年3月27日)	640,394,940	643,469,063	1.4582	1.4652
第6特定期間末 (平成27年9月28日)	526,538,445	529,198,754	1.3855	1.3925
第7特定期間末 (平成28年3月28日)	434,864,657	437,328,032	1.2357	1.2427
第8特定期間末 (平成28年9月27日)	373,960,260	376,307,989	1.1150	1.1220

第9特定期間末 (平成29年3月27日)	400,718,613	403,081,178	1.1873	1.1943
平成29年4月末日	403,255,136	-	1.1877	-
5月末日	387,797,017	-	1.1887	-
6月末日	374,145,414	-	1.2001	-
7月末日	364,904,981	-	1.1828	-
8月末日	357,243,626	-	1.1654	-
第10特定期間末 (平成29年9月27日)	354,730,423	356,827,358	1.1842	1.1912
9月末日	356,925,901	-	1.1879	-
10月末日	342,979,482	-	1.1850	-
11月末日	334,690,686	-	1.1620	-
12月末日	337,511,673	-	1.1680	-
平成30年1月末日	323,636,065	-	1.1160	-
2月末日	280,302,412	-	1.0850	-
第11特定期間末 (平成30年3月27日)	269,526,792	271,328,745	1.0470	1.0540
3月末日	274,902,033	-	1.0633	-
4月末日	279,504,309	-	1.0811	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0100
第2特定期間	0.0120
第3特定期間	0.0120
第4特定期間	0.0170
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	21.2
第2特定期間	2.0
第3特定期間	6.7
第4特定期間	8.3
第5特定期間	9.3
第6特定期間	2.1
第7特定期間	7.8
第8特定期間	6.4
第9特定期間	10.3
第10特定期間	3.3
第11特定期間	8.0

(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	693,143,738	265,463,027
第2特定期間	589,428,447	694,685,695
第3特定期間	69,731,029	217,848,794
第4特定期間	27,854,252	80,623,142
第5特定期間	70,447,366	145,851,678
第6特定期間	10,328,467	69,444,832
第7特定期間	24,215,210	52,348,605
第8特定期間	38,455,795	54,976,600
第9特定期間	24,406,722	22,287,282
第10特定期間	5,993,614	43,940,782
第11特定期間	5,792,859	47,933,251

(注) 当初設定数量は393,028,055口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)」の記載と同じ。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

● ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)

2018年4月27日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,050円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.7%
3カ月間	-2.3%
6カ月間	-3.0%
1年間	-2.4%
3年間	-5.4%
5年間	-5.1%
設定来	-3.1%



※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: 120円 設定来分配金合計額: 660円

決算期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	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	18年2月	18年3月	18年4月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

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

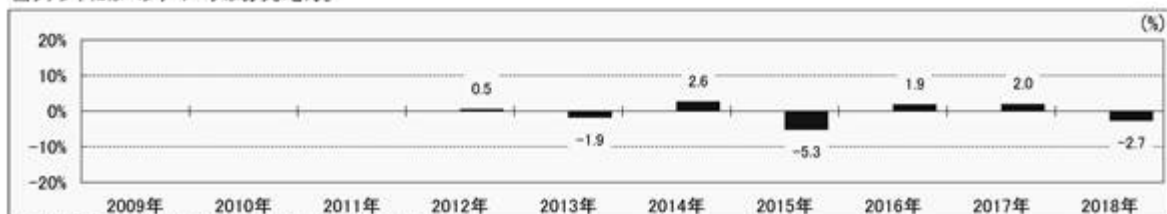
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ニューバーガー・パーマニ・インベストメント・アドバイザーズLLC/大和証券投資信託委託	ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(円ヘッジクラス)	99.1%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.0%
合計		99.1%

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。

・2012年は設定日(9月28日)から年末、2018年は4月27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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)

2018年4月27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	10,811円
純資産総額	2.7億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.3%
3カ月間	-1.2%
6カ月間	-5.3%
1年間	-2.1%
3年間	-8.6%
5年間	12.3%
設定来	43.2%

※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: 840円 設定来分配金合計額: 3,520円

決算期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	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	18年2月	18年3月	18年4月
分配金	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70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を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。

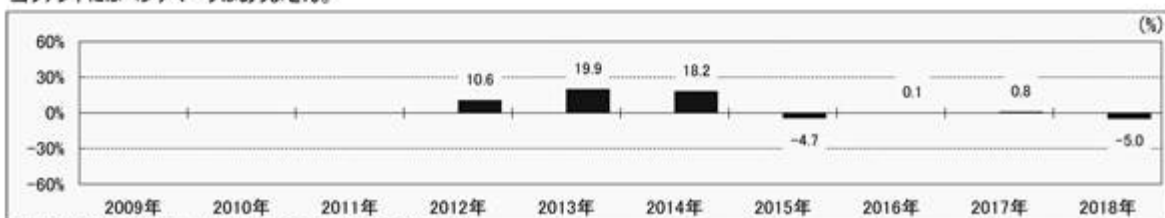
主要な資産の状況

※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
ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズLLC	ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジクラス)	99.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.0%
合計		99.5%

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。

・2012年は設定日(9月28日)から年末、2018年は4月27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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（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9月28日から平成30年3月27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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	6,016,758
コール・ローン	8,893,923	4,768,204
投資信託受益証券	1,163,549,827	1,046,881,883
親投資信託受益証券	1,236	1,235
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	1,177,444,986	1,057,668,080
資産合計	1,177,444,986	1,057,668,080
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,244,737	1,160,693
未払受託者報酬	31,458	26,450
未払委託者報酬	1,153,695	970,154
その他未払費用	51,851	44,727
流動負債合計	2,481,741	2,202,024
負債合計	2,481,741	2,202,024
純資産の部		
元本等		
元本	1,244,737,151	1,160,693,689
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	69,773,906	105,227,633
(分配準備積立金)	111,043,819	102,691,665
元本等合計	1,174,963,245	1,055,466,056
純資産合計	1,174,963,245	1,055,466,056
負債純資産合計	1,177,444,986	1,057,668,080

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年3月28日 至 平成29年9月27日	自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	16,435,754	13,121,564
有価証券売買等損益	8,683,731	40,289,509
営業収益合計	25,119,485	27,167,945
営業費用		
支払利息	2,942	2,728
受託者報酬	207,716	178,748
委託者報酬	7,617,756	6,555,663
その他費用	52,196	44,727
営業費用合計	7,880,610	6,781,866
営業利益又は営業損失 ()	17,238,875	33,949,811
経常利益又は経常損失 ()	17,238,875	33,949,811
当期純利益又は当期純損失 ()	17,238,875	33,949,811
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	7,279	151,187
期首剰余金又は期首欠損金 ()	94,845,615	69,773,906
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,970,493	5,623,234
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	15,970,493	5,623,234
剰余金減少額又は欠損金増加額	167,318	157,179
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	167,318	157,179
分配金 1	7,963,062	7,121,158
期末剰余金又は期末欠損金 ()	69,773,906	105,227,633

(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9月28日	至 平成30年3月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資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。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
1. 1期首元本額	1,517,365,485円	1,244,737,151円
期中追加設定元本額	2,909,648円	2,376,709円
期中一部解約元本額	275,537,982円	86,420,171円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,244,737,151口	1,160,693,689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69,773,906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105,227,633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3月28日 至 平成29年9月27日	自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27日

1 分配金の計算過程	<p>（自平成29年3月28日 至平成29年4月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,325,393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（4,769,829円）及び分配準備積立金（124,534,119円）より分配対象額は131,629,341円（1万口当たり917.92円）であり、うち1,433,990円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年9月28日 至平成29年10月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,062,289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（4,315,991円）及び分配準備積立金（109,706,362円）より分配対象額は115,084,642円（1万口当たり935.53円）であり、うち1,230,153円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年4月28日 至平成29年5月29日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,553,504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（4,736,083円）及び分配準備積立金（123,278,028円）より分配対象額は130,567,615円（1万口当たり926.03円）であり、うち1,409,965円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年10月28日 至平成29年11月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,281,977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（4,241,328円）及び分配準備積立金（106,700,000円）より分配対象額は112,223,305円（1万口当たり936.23円）であり、うち1,198,677円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年5月30日 至平成29年6月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,136,225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（4,434,894円）及び分配準備積立金（115,356,261円）より分配対象額は121,927,380円（1万口当たり932.37円）であり、うち1,307,709円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年11月28日 至平成29年12月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,413,019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（4,233,980円）及び分配準備積立金（105,684,235円）より分配対象額は111,331,234円（1万口当たり938.13円）であり、うち1,186,732円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>

<p>（自平成29年6月28日 至平成29年7月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,501,029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（4,438,010円）及び分配準備積立金（115,241,693円）より分配対象額は121,180,732円（1万口当たり933.94円）であり、うち1,297,518円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年12月28日 至平成30年1月29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（906,932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（4,223,331円）及び分配準備積立金（104,739,879円）より分配対象額は109,870,142円（1万口当たり935.86円）であり、うち1,174,005円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年7月28日 至平成29年8月28日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,145,948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（4,377,528円）及び分配準備積立金（112,883,971円）より分配対象額は118,407,447円（1万口当たり932.97円）であり、うち1,269,143円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年1月30日 至平成30年2月27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（823,244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（4,245,740円）及び分配準備積立金（104,162,737円）より分配対象額は109,231,721円（1万口当たり932.89円）であり、うち1,170,898円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年8月29日 至平成29年9月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,733,123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（4,330,275円）及び分配準備積立金（110,555,433円）より分配対象額は116,618,831円（1万口当たり936.90円）であり、うち1,244,737円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年2月28日 至平成30年3月27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（975,842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（4,242,530円）及び分配準備積立金（102,876,516円）より分配対象額は108,094,888円（1万口当たり931.30円）であり、うち1,160,693円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期
	自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27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3月27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9月27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3月27日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	1,907,842	11,399,849
親投資信託受益証券	0	0
合計	1,907,842	11,399,849

（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9月27日現在	平成30年3月27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9月28日 至 平成30年3月27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9月27日現在	当 期 平成30年3月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9439円 (9,439円)	0.9093円 (9,093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	NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED CLASS	12,396,763.490	1,046,881,883	
投資信託受益証券 合計			1,046,881,883	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,235	1,235	
親投資信託受益証券 合計			1,235	
合計			1,046,883,118	

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・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(円ヘッジクラス)」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・マネーアセット・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・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）」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

2017年2月28日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$31,604,170）	\$	31,715,556
現金		3,476
外国通貨の評価額（簿価 \$1,453）		5
外国為替先渡契約による評価益		41,703
未収：		
売却済みの投資（繰延受渡）		417,491
売却済みの投資		371,933
利息		102,667
受益証券の発行		16,088
未収変動証拠金		66,132
前払受託会社報酬		12,615
資産合計		32,747,666

負債

外国為替先渡契約による評価損		135
未払：		
購入済みの投資（繰延受渡）		6,007,081
購入済みの投資		332,037
専門家報酬		57,577
運用会社報酬		22,968
保管会社報酬		22,235
償還済み受益証券		14,300
会計および管理会社報酬		7,202
名義書換代理人報酬		1,222
為替取引執行会社報酬		317
為替運用会社報酬		188
その他負債		400
負債合計		6,465,662

純資産

\$ 26,282,004

純資産

通貨セレクトクラス	1,575,036
通貨分散/N1クラス	151,829
円ヘッジクラス	13,345,723
円ヘッジ/N1クラス	4,873,483
ノンヘッジクラス	3,426,627

ノンヘッジ/N1クラス	2,909,306
	\$ 26,282,004

発行済み受益証券

通貨セレクトクラス	2,441,600
通貨分散/N1クラス	194,893
円ヘッジクラス	17,070,024
円ヘッジ/N1クラス	5,111,676
ノンヘッジクラス	2,966,002
ノンヘッジ/N1クラス	2,622,653

受益証券1口当り純資産額

通貨セレクトクラス	0.645
通貨分散/N1クラス	0.779
円ヘッジクラス	0.782
円ヘッジ/N1クラス	0.953
ノンヘッジクラス	1.155
ノンヘッジ/N1クラス	1.109

損益計算書

2017年2月28日に終了した年度

投資収益

受取利息（源泉徴収税 \$15,284 控除後）	\$ 751,941
配当収益（源泉徴収税 \$130,362 控除後）	304,178
投資収益合計	1,056,119

費用

運用会社報酬	158,974
保管会社報酬	130,294
専門家報酬	56,150
会計および管理会社報酬	44,877
名義書換代理人報酬	12,783
受託会社報酬	12,566
為替運用会社報酬	3,050
為替取引執行会社報酬	2,107
登録料	1,023
その他費用	2,423
費用合計	424,247

投資純利益

631,872

実現益（損）および評価益（損）：**実現益（損）：**

証券投資	(471,918)
先物取引	(5,580)
スワップ契約	(49,512)
外国為替取引および外国為替先渡契約	854,919
純実現益	327,909

評価益（損）の純変動：

証券投資	2,198,283
スワップ契約	16,415
先物取引	(6,476)

外国為替換算および外国為替先渡契約	(709,156)
評価益の純変動	1,499,066
純実現・純評価益	1,826,975
運用による純資産の純増	\$ 2,458,847

(米ドル建て)

投資明細表
2017年2月28日

	元本	有価証券の明細	対純資産 比率	評価額
		債券 (81.8%)		
		メキシコ (2.4%)		
		国債 (2.4%)		
		Mexican Bonos		
MXN	6,000,000	5.75% due 03/05/26		\$ 268,486
MXN	7,520,000	7.75% due 11/13/42		372,469
		国債合計		640,955
		メキシコ合計 (簿価 \$813,733)		640,955
		オランダ (0.4%)		
		社債 (0.4%)		
		Mylan NV(a)		
USD	95,000	3.95% due 06/15/26		92,792
		社債合計		92,792
		オランダ合計 (簿価 \$94,313)		92,792
		ニュージーランド (0.4%)		
		国債 (0.4%)		
		New Zealand Government Bond		
NZD	125,000	2.50% due 09/20/35		92,437
		国債合計		92,437
		ニュージーランド合計 (簿価 \$100,923)		92,437
		南アフリカ (1.8%)		
		国債 (1.8%)		
		Republic of South Africa Government Bond		
ZAR	8,560,000	6.50% due 02/28/41		467,050
		国債合計		467,050
		南アフリカ合計 (簿価 \$583,620)		467,050
		英国 (0.7%)		
		社債 (0.7%)		
		Barclays PLC(a)		
USD	175,000	4.34% due 01/10/28		176,913
		社債合計		176,913
		英国合計 (簿価 \$175,000)		176,913
		米国 (76.1%)		
		資産担保証券 (21.6%)		
		Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 Class A4(a),(b)		
USD	270,000	1.06% due 04/25/36		246,898
		American Airlines Pass-Through Trust Series 2014-1 Class B		
USD	106,777	4.38% due 10/01/22		106,777
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2005-NC5 Class M1(a),(b)		
USD	280,000	1.26% due 10/25/35		259,531
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 Class A4(a),(b)		

USD	415,000	1.09% due 01/25/36 Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-RFC1 Class A4(a),(b)	389,671
USD	415,000	1.02% due 05/25/36 Chase Issuance Trust Series 2016-A7 Class A7	387,601
USD	698,000	1.06% due 09/16/19 Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-OPT3 Class M3(a),(b)	697,459
USD	700,000	1.50% due 05/25/35 COMM Mortgage Trust Series 2013-LC6 Class XB(b),(c)	674,826
USD	4,000,000	0.35% due 01/10/46 COMM Mortgage Trust Series 2014-CR17 Class XA(b)	86,256
USD	1,508,163	0.84% due 05/10/47 COMM Mortgage Trust Series 2014-UBS3 Class XA(b)	82,132
USD	1,261,511	1.32% due 06/10/47 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-Ab1 Class M1(a),(b)	76,422
USD	145,000	1.41% due 08/25/35 GS Mortgage Securities Trust Series 2014-GC18 Class XA(b)	141,225
USD	1,481,594	1.13% due 01/10/47 GSAA Home Equity Trust Series 2005-5 Class B1(a),(b)	80,388
USD	90,000	2.50% due 02/25/35 Home Equity Asset Trust Series 2005-1 Class M5(a),(b)	80,166
USD	65,000	1.87% due 05/25/35 HSI Asset Securitization Corp. Trust Series 2006-OPT1 Class M1(a),(b)	58,808
USD	50,000	1.14% due 12/25/35 JP Morgan Mortgage Acquisition Trust Series 2007-CH1 Class MV2(a),(b)	47,577
USD	115,000	1.06% due 11/25/36 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2014-C16 Class XA(b)	108,238
USD	1,550,631	1.19% due 06/15/47 Navient Student Loan Trust Series 2016-6A Class A1(a),(b),(c)	86,489
USD	102,636	1.26% due 03/25/66 New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B Class A2D(a),(b)	102,787
USD	157,751	1.18% due 10/25/35 Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-WCH1 Class M4(a),(b)	155,743
USD	303,000	2.02% due 01/25/36 RAAC Trust Series 2006-SP2 Class M1(a),(b)	297,141
USD	200,000	1.12% due 02/25/36 RAMP Trust Series 2005-RZ1 Class M5(a),(b)	185,829
USD	238,889	1.41% due 10/25/34 RAMP Trust Series 2005-RZ2 Class M4(a),(b)	228,895
USD	230,000	1.34% due 05/25/35 RASC Trust Series 2005-KS10 Class M2(a),(b)	219,290
USD	385,000	1.22% due 11/25/35 Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2005-WF4 Class M4(a),(b)	367,398
USD	350,000	1.36% due 11/25/35 Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2006-AM1 Class A4(a),(b)	335,489
USD	167,149	0.94% due 04/25/36	163,977
		資産担保証券合計	5,667,013
		社債 (18.6%)	
		Abbott Laboratories(a)	
USD	70,000	4.90% due 11/30/46 AbbVie, Inc.(a)	72,776
USD	100,000	4.45% due 05/14/46 Air Lease Corp.	96,908

USD	80,000	2.13% due 01/15/20 Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.(a)	79,164
USD	30,000	3.65% due 02/01/26 Apple, Inc.(a)	30,519
USD	85,000	4.65% due 02/23/46 AT&T, Inc.(a)	92,426
USD	180,000	4.75% due 05/15/46	168,322
USD	175,000	5.70% due 03/01/57 Bank of America Corp.	180,531
USD	125,000	3.95% due 04/21/25 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital(a)	125,464
USD	175,000	4.91% due 07/23/25	184,346
USD	130,000	6.48% due 10/23/45 Citigroup, Inc.	150,887
USD	140,000	4.40% due 06/10/25 Diamond 1 Finance Corp. / Diamond 2 Finance Corp.(a),(c)	143,806
USD	165,000	4.42% due 06/15/21	173,026
USD	145,000	5.45% due 06/15/23 Discover Financial Services(a)	156,699
USD	115,000	4.10% due 02/09/27 Energy Transfer Partners LP(a)	115,851
USD	75,000	6.50% due 02/01/42 EPR Properties(a)	84,661
USD	130,000	5.75% due 08/15/22 ERAC USA Finance LLC(a),(c)	141,987
USD	75,000	4.20% due 11/01/46 Ford Motor Co.(a)	70,006
USD	95,000	4.35% due 12/08/26 General Motors Co.(a)	97,695
USD	70,000	6.75% due 04/01/46 General Motors Financial Co., Inc.(a)	85,013
USD	110,000	3.20% due 07/06/21	111,297
USD	130,000	4.00% due 10/06/26	129,412
USD	95,000	4.30% due 07/13/25 Georgia Power Co.(a)	96,783
USD	90,000	3.25% due 03/30/27 Goldman Sachs Group, Inc.	89,898
USD	185,000	2.35% due 11/15/21(a)	181,207
USD	95,000	5.15% due 05/22/45 Hess Corp.(a)	101,245
USD	120,000	4.30% due 04/01/27 Hewlett Packard Enterprise Co.(a)	120,035
USD	155,000	4.90% due 10/15/25 HP, Inc.	161,282
USD	145,000	4.65% due 12/09/21 Kinder Morgan Energy Partners LP(a)	155,379
USD	25,000	5.50% due 03/01/44 Kinder Morgan, Inc.(a)	25,977
USD	95,000	5.55% due 06/01/45 Microsoft Corp.(a)	100,247
USD	90,000	4.50% due 02/06/57 Morgan Stanley	93,386
USD	185,000	3.63% due 01/20/27	184,317
USD	85,000	4.38% due 01/22/47	86,396
USD	60,000	5.45% due 12/31/49(a),(b),(d) Noble Energy, Inc.(a)	61,547

USD	85,000	5.25% due 11/15/43 Novartis Capital Corp.(a)	89,613
USD	55,000	3.10% due 05/17/27 Omega Healthcare Investors, Inc.(a)	55,087
USD	55,000	4.50% due 01/15/25 Reynolds American, Inc.(a)	55,046
USD	60,000	4.45% due 06/12/25 Seagate HDD Cayman(a),(c)	63,442
USD	145,000	4.88% due 03/01/24 Verizon Communications, Inc.	141,935
USD	60,000	4.13% due 08/15/46	52,589
USD	114,000	4.67% due 03/15/55 Viacom, Inc.	103,785
USD	65,000	3.88% due 04/01/24(a)	64,745
USD	160,000	4.38% due 03/15/43	140,402
USD	180,000	5.88% due 02/28/57(a),(b)	183,301
		社債合計	4,898,440
		国債 (35.9%)	
		Federal Home Loan Mortgage Corp., TBA(e)	
USD	395,000	3.00% due 03/01/31	406,353
USD	585,000	3.00% due 03/01/47	580,580
USD	255,000	3.50% due 03/01/46	261,345
USD	1,040,000	4.00% due 03/01/46 Federal National Mortgage Association, TBA(e)	1,093,082
USD	255,000	3.00% due 03/01/32	262,212
USD	630,000	3.00% due 03/01/46	625,767
USD	240,000	3.50% due 03/01/46	246,019
USD	1,365,000	4.00% due 03/01/47	1,434,541
USD	80,000	4.50% due 03/01/47 Government National Mortgage Association, TBA(e)	85,963
USD	310,000	3.00% due 03/01/46	313,681
USD	105,000	3.50% due 03/01/46	109,151
USD	170,000	4.00% due 03/01/47 Resolution Funding Corp. Interest Strip	179,895
USD	145,000	zero coupon due 04/15/29 U.S. Treasury Bonds	100,074
USD	365,000	3.88% due 08/15/40	425,026
USD	30,000	5.50% due 08/15/28 U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds	39,110
USD	133,806	2.00% due 01/15/26	153,010
USD	106,828	2.50% due 01/15/29	131,863
USD	104,490	3.63% due 04/15/28	140,130
USD	1,307,072	3.88% due 04/15/29 U.S. Treasury Inflation Indexed Note	1,826,523
USD	377,152	0.25% due 01/15/25 U.S. Treasury Notes	376,290
USD	65,000	1.50% due 02/28/23	62,880
USD	115,000	1.63% due 02/15/26	108,190
USD	145,000	2.13% due 12/31/21	146,557
USD	70,000	2.75% due 02/15/24	72,557
USD	250,000	3.63% due 08/15/19	263,740
		国債合計	9,444,539
		米国合計 (簿価 \$19,710,110)	20,009,992
		債券 (簿価 \$21,477,699)	21,480,139
口数		上場投資信託(ETF) (27.7%)	
		米国 (27.7%)	
22,620		iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	1,997,120

	8,200	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	931,192		
	100,709	PowerShares Senior Loan Portfolio	2,353,569		
	53,910	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond ETF	2,006,530		
		米国合計	7,288,411		
		上場投資信託(ETF)合計 (簿価 \$7,179,465)	7,288,411		
	元本	短期投資 (11.2%)			
		米国 (1.9%)			
		国債 (1.9%)			
		U.S. Treasury Bill*			
USD	500,000	0.77% due 06/22/17	499,231		
		国債合計	499,231		
		米国合計 (簿価 \$499,231)	499,231		
		グランド・ケイマン (0.1%)			
		定期預金 (0.1%)			
		Brown Brothers Harriman & Co.			
EUR	0**	(0.58)% due 03/01/17	1		
JPY	46,689	(0.20)% due 03/01/17	417		
GBP	6	0.05% due 03/01/17	7		
CAD	54	0.05% due 03/01/17	41		
AUD	907	0.49% due 03/01/17	697		
NZD	839	0.80% due 03/01/17	607		
ZAR	280,869	5.45% due 03/01/17	21,473		
		定期預金合計	23,243		
		グランド・ケイマン合計 (簿価 \$23,243)	23,243		
		スウェーデン (9.2%)			
		定期預金 (9.2%)			
		Skandinaviska Enskilda Banken AB			
USD	2,424,532	0.27% due 03/01/17	2,424,532		
		定期預金合計	2,424,532		
		スウェーデン合計 (簿価 \$2,424,532)	2,424,532		
		短期投資合計 (簿価 \$2,947,006)	2,947,006		
		投資総額 (簿価 \$31,604,170)		120.7%	\$ 31,715,556
		現金および他の資産を超過する負債		(20.7)	(5,433,552)
		純資産		100.0%	\$ 26,282,004

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最善の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

用語集：

TBA To be announced (事後告知)の略。米国政府機関によって発行される不動産ローン担保証券の先渡取引で、合意された将来の決済日に受渡しがされます。

*この証券の全てもしくは一部が2017年2月28日時点の先物取引の担保として取引相手に差し入れられています。

**0.05未満

- 償還条項付き証券。
- 2017年2月28日時点の 変動金利証券。
- 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投資家に転売が可能です。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ません。
- 永久債。
- 発行日取引または繰延受渡しベースで購入された証券。

2017年2月28日時点の先物取引(純資産の-0.2%)

ポジション	銘柄	限月	枚数	評価益/(損)
Long	British Pound March Futures	2017年3月	3	\$ (3,762)
Short	Euro Buxl 30 Year Bond June Futures	2017年6月	(4)	(2,975)
Short	Euro FX March Futures	2017年3月	(7)	(4,143)
Short	Euro-Bobl June Futures	2017年6月	(3)	(191)
Short	Euro-Bund June Futures	2017年6月	(1)	(340)
Short	Euro-OAT June Futures	2017年6月	(5)	(1,371)
Short	Long Gilt June Futures	2017年6月	(6)	(15,904)
Short	Mexican Peso March Futures	2017年3月	(4)	(1,950)
Short	New Zealand Dollar March Futures	2017年3月	(1)	(920)
Short	South African Rand (CME) March Futures	2017年3月	(13)	(32,611)
Long	Swedish Krona March Futures	2017年3月	1	2,958
Short	U.S. Treasury 10 Year Note (CBT) June Futures	2017年6月	(15)	(7,735)
Long	U.S. Treasury 10 Year Ultra June Futures	2017年6月	8	8,688
Long	U.S. Treasury Long Bond (CBT) June Futures	2017年6月	4	6,018
Long	U.S. Treasury Ultra Bond (CBT) June Futures	2017年6月	3	6,956
Short	United States Dollar March Futures	2017年3月	(7)	(1,365)
Short	USD IRS 10 Year Prim March Futures	2017年3月	(1)	(639)
				\$ (49,286)

2017年2月28日時点で、中央清算対象スワップ取引の累積マージンとして、\$10,349が支払われました。

2017年2月28日時点の中央清算対象のクレジット・デフォルト・スワップ(純資産の0.1%)

通貨	取引相手	想定元本	信用プロ テクション	インデックス	受取 /(支払)	インプライド 信用スプレッド	満期日	評価益 /(損)
USD	JP Morgan Chase & Co.	717,750	Sell	CDX.NA.HY.27 Index	5.000%	3.51%	2021年12月20日	\$ 16,538

2017年2月28日時点の通過セレクトクラス外国為替先渡契約(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	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
BRL	Citibank N.A.	891,195	2017年3月10日	USD	283,021	\$ 2,858	\$ -	\$ 2,858
IDR	Citibank N.A.	3,332,806,124	2017年3月10日	USD	249,835	-	(135)	(135)
INR	Citibank N.A.	17,448,929	2017年3月10日	USD	259,348	1,921	-	1,921
RUB	Citibank N.A.	15,617,192	2017年3月10日	USD	261,819	4,829	-	4,829
TRY	Citibank N.A.	1,033,187	2017年3月10日	USD	275,581	8,619	-	8,619
ZAR	Citibank N.A.	3,227,894	2017年3月10日	USD	239,352	7,088	-	7,088
						\$ 25,315	\$ (135)	\$ 25,180

2017年2月28日時点の円ヘッジクラス外国為替先渡契約(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	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	Citibank N.A.	1,491,610,675	2017年3月10日	USD	13,325,958	\$ 8,369	\$ -	\$ 8,369

2017年2月28日時点の円ヘッジ/N1クラス外国為替先渡契約(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	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
----	------	------	-----	----	------	-----	-------	----------

JPY	Citibank N.A.	546,018,977	2017年3月10日	USD	4,873,143	\$	8,019	\$	-	\$	8,019
-----	---------------	-------------	------------	-----	-----------	----	-------	----	---	----	-------

2017年2月28日時点の通貨分散 / N 1 クラスのトータル・リターン・スワップ (純資産の0.0%)

想定元本	取引相手	参照法人	通貨	満期日	評価額
141,295	Nomura Securities Co., Ltd.	Nomura 12 Currency Basket Strategy	USD	2017年3月31日	\$ -

通貨の略称

AUD	-	オーストラリア・ドル
BRL	-	ブラジル・レアル
CAD	-	カナダ・ドル
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
IDR	-	インドネシア・ルピア
INR	-	インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
NZD	-	ニュージーランド・ドル
RUB	-	ロシア・ルーブル
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

[次へ](#)

「ダイワ・マネーアセット・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9月27日現在	平成30年3月27日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	9,376,835,754
コール・ローン	13,589,509,314	7,431,023,503
流動資産合計	13,589,509,314	16,807,859,257
資産合計	13,589,509,314	16,807,859,257
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	-	181,057
流動負債合計	-	181,057
負債合計	-	181,057
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,575,603,904
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,905,410	12,065,968
元本等合計	13,589,509,314	16,807,678,200
純資産合計	13,589,509,314	16,807,678,200
負債純資産合計	13,589,509,314	16,807,859,257

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9月28日 至 平成30年3月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
1. 1 期首	平成29年3月28日	平成29年9月28日
期首元本額	10,398,021,025円	13,575,603,904円
期中追加設定元本額	5,014,671,494円	4,760,681,066円
期中一部解約元本額	1,837,088,615円	1,540,672,738円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ債券コア戦略ファンド （為替ヘッジあり）	999円	999円

ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし)	999円	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (毎月分配型)	219,583円	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (年2回決算型)	24,953円	24,953円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(毎月分配型)	848,389円	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(年2回決算型)	66,873円	66,873円
ダイワ米国株主還元株ファン ド	36,730,213円	36,730,213円
ダイワDBモメンタム戦略 ファンド(為替ヘッジあり)	6,592,748円	6,592,748円
ダイワDBモメンタム戦略 ファンド(為替ヘッジなし)	10,288,683円	10,288,683円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	4,995円	4,995円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	4,995円	4,995円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-04(為替ヘッジあり/ 限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-07(為替ヘッジあり/ 限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-10(為替ヘッジあり/ 限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2015-01(為替ヘッジあり/ 限定追加型)	999円	999円
ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 50 コース	49,911円	49,911円
ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 100 コース	49,911円	49,911円
ダイワ・オーストラリア高配 当株ファンド・マネー・ポー トフォリオ	33,336,056円	12,126,285円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver3 -	858,588,190円	858,588,190円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver6 -	3,325,620,751円	3,325,620,751円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver7 -	828,595,357円	828,595,357円

ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver4	- 円	2,906,981,097円
-		
ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト12 Ver2	- 円	549,443,563円
-		
ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver5	2,095,808,384円	2,095,808,384円
-		
ダイワ円債セレクト マネーコース	857,472,241円	643,793,365円
ダイワ・スイス高配当株ツイン (毎月分配型)	2,996,106円	2,996,106円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース	5,990,216円	5,990,216円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース	1,397,544円	1,397,544円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	3,994,008円	3,994,008円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクト・コース	1,597,623円	1,597,623円
ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジあり	40,885円	40,885円
ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジなし	100,789円	100,789円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)	1,235円	1,235円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)	1,598円	1,598円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型)	1,544円	1,544円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース(毎月分配型)	1,984円	1,984円
ダイワ新興国ハイインカム・プラス - インカムチェンジ(積立型) -	1,527,685円	- 円
ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト11 -	3,536,610,361円	3,536,610,361円
ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト12 -	679,321,043円	679,321,043円
ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト13 -	1,287,713,056円	1,287,713,056円
計	13,575,603,904円	16,795,612,232円
2. 期末日における受益権の総数	13,575,603,904口	16,795,612,232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9月28日 至 平成30年3月27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3月27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）

平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（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9月27日現在	平成30年3月27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9月27日現在	平成30年3月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0010円 (10,010円)	1.0007円 (10,007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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（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9月28日から平成30年3月27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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,220,845
コール・ローン	5,071,541	2,552,478
投資信託受益証券	352,490,421	265,824,767
親投資信託受益証券	1,599	1,599
流動資産合計	357,563,561	271,599,689
資産合計	357,563,561	271,599,689
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,096,935	1,801,953
未払解約金	363,957	-
未払受託者報酬	9,470	6,845
未払委託者報酬	347,440	251,119
その他未払費用	15,336	12,980
流動負債合計	2,833,138	2,072,897
負債合計	2,833,138	2,072,897
純資産の部		
元本等		
元本	1 299,562,258	257,421,866
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	55,168,165	12,104,926
(分配準備積立金)	29,942,181	18,460,414
元本等合計	354,730,423	269,526,792
純資産合計	354,730,423	269,526,792
負債純資産合計	357,563,561	271,599,689

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年3月28日 至 平成29年9月27日	自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	6,811,278	5,809,229
有価証券売買等損益	7,930,125	30,474,883
営業収益合計	14,741,403	24,665,654
営業費用		
支払利息	1,092	1,206
受託者報酬	61,647	52,091
委託者報酬	2,261,958	1,911,875
その他費用	15,391	12,980
営業費用合計	2,340,088	1,978,152
営業利益又は営業損失 ()	12,401,315	26,643,806
経常利益又は経常損失 ()	12,401,315	26,643,806
当期純利益又は当期純損失 ()	12,401,315	26,643,806
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	191,164	968,477
期首剰余金又は期首欠損金 ()	63,209,187	55,168,165
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,105,531	849,961
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,105,531	849,961
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,145,843	6,566,270
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	8,145,843	6,566,270
分配金 1	13,210,861	11,671,601
期末剰余金又は期末欠損金 ()	55,168,165	12,104,926

(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9月28日	至 平成30年3月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資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。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成29年9月27日現在	平成30年3月27日現在
1. 1期首元本額	337,509,426円	299,562,258円
期中追加設定元本額	5,993,614円	5,792,859円
期中一部解約元本額	43,940,782円	47,933,251円
2. 特定期間末日における受益権の総数	299,562,258口	257,421,866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3月28日 至 平成29年9月27日	自 平成29年9月28日 至 平成30年3月27日

1 分配金の計算過程	<p>（自平成29年3月28日 至平成29年4月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,149,607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（85,778,503円）及び分配準備積立金（42,474,796円）より分配対象額は129,402,906円（1万口当たり3,822.61円）であり、うち2,369,637円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年9月28日 至平成29年10月27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（891,817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（73,721,094円）及び分配準備積立金（28,759,054円）より分配対象額は103,371,965円（1万口当たり3,581.95円）であり、うち2,020,140円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年4月28日 至平成29年5月29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（922,533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（82,542,382円）及び分配準備積立金（39,519,671円）より分配対象額は122,984,586円（1万口当たり3,780.97円）であり、うち2,276,905円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年10月28日 至平成29年11月27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（645,983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（73,413,924円）及び分配準備積立金（27,404,135円）より分配対象額は101,464,042円（1万口当たり3,534.45円）であり、うち2,009,501円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>
	<p>（自平成29年5月30日 至平成29年6月27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（961,852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（78,986,818円）及び分配準備積立金（36,359,703円）より分配対象額は116,308,373円（1万口当たり3,741.92円）であり、うち2,175,777円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年11月28日 至平成29年12月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,009,352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（73,747,815円）及び分配準備積立金（26,040,617円）より分配対象額は100,797,784円（1万口当たり3,499.49円）であり、うち2,016,247円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>

<p>（自平成29年6月28日 至平成29年7月27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（995,876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（78,261,153円）及び分配準備積立金（34,672,825円）より分配対象額は113,929,854円（1万口当たり3,704.30円）であり、うち2,152,926円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年12月28日 至平成30年1月29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（657,132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（74,071,881円）及び分配準備積立金（25,033,547円）より分配対象額は99,762,560円（1万口当たり3,452.23円）であり、うち2,022,858円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年7月28日 至平成29年8月28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（693,179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（77,847,332円）及び分配準備積立金（33,189,981円）より分配対象額は111,730,492円（1万口当たり3,656.99円）であり、うち2,138,681円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年1月30日 至平成30年2月27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（538,286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（66,020,278円）及び分配準備積立金（20,994,978円）より分配対象額は87,553,542円（1万口当たり3,403.15円）であり、うち1,800,902円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年8月29日 至平成29年9月27日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,020,153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（76,433,630円）及び分配準備積立金（31,018,963円）より分配対象額は108,472,746円（1万口当たり3,621.04円）であり、うち2,096,935円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年2月28日 至平成30年3月27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（601,335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（66,141,663円）及び分配準備積立金（19,661,032円）より分配対象額は86,404,030円（1万口当たり3,356.51円）であり、うち1,801,953円（1万口当たり70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9月28日 至 平成30年3月27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3月27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9月27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3月27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	10,157,988	7,514,925
親投資信託受益証券	0	0
合計	10,157,988	7,514,925

（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9月27日現在	平成30年3月27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9月28日 至 平成30年3月27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9月27日現在	当 期 平成30年3月27日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1842円 (11,842円)	1.0470円 (10,470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	NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED CLASS	2,248,236.740	265,824,767	
投資信託受益証券 合計			265,824,767	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,598	1,599	
親投資信託受益証券 合計			1,599	
合計			265,826,366	

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・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジクラス)」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・マネーアセット・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・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジクラス)」の状況

前記「ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）

【純資産額計算書】

平成30年4月27日

資産総額	1,037,108,572円
負債総額	2,243,138円
純資産総額（ - ）	1,034,865,434円
発行済数量	1,143,538,815口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9050円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年4月27日

資産総額	13,583,988,864円
負債総額	386,598円
純資産総額（ - ）	13,583,602,266円
発行済数量	13,574,903,834口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0006円

ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）

純資産額計算書

平成30年4月27日

資産総額	281,602,953円
負債総額	2,098,644円
純資産総額（ - ）	279,504,309円
発行済数量	258,548,290口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0811円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（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4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年間に於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4月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	192,189
追加型株式投資信託	703	15,293,945
株式投資信託 合計	784	15,486,134
単位型公社債投資信託	25	103,908
追加型公社債投資信託	14	1,482,732
公社債投資信託 合計	39	1,586,639
総合計	823	17,072,774

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	1
建物	243	229
器具備品	18	15
	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。）。

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第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5月11日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）の平成29年9月28日から平成30年3月27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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）の平成30年3月27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5月11日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）の平成29年9月28日から平成30年3月27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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）の平成30年3月27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。