

【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29年12月14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/フィデリティ北米株式ファンド
- パラダイムシフト -

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続申込期間（平成29年6月15日から平成30年6月12日まで）
10兆円を上限とします。

【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】

平成29年6月14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、半期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（平成29年9月末日現在）>

<略>

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

上記の運用体制は平成29年9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>

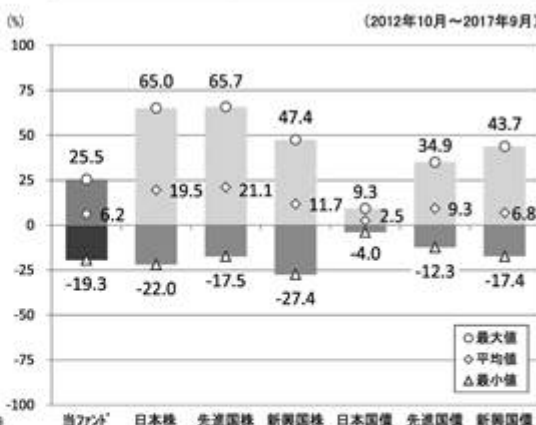
参考情報

- 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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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、平成29年9月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

5 【運用状況】

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

<訂正後>

(1) 【投資状況】（平成29年9月29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	10,638,544,299	98.96
内 日本	10,638,544,299	98.96
親投資信託受益証券	30,042,199	0.28
内 日本	30,042,199	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	81,846,206	0.76
純資産総額	10,750,432,704	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29年9月29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	フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ	日本	投資信託 受益証券	7,221,384,944	1.4224 10,272,218,562	1.4732 10,638,544,299	98.96
2	ダイワ・マネー・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	29,484,934	1.0193 30,053,993	1.0189 30,042,199	0.28

(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	98.96%
親投資信託受益証券	0.28%
合計	99.24%

(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計算期間末 (平成26年3月18日)	37,440,821,028	40,825,678,483	1.1061	1.2061
第2計算期間末 (平成27年3月18日)	27,800,957,121	29,234,177,710	1.1639	1.2239
第3計算期間末 (平成28年3月18日)	17,204,082,514	17,204,082,514	1.0138	1.0138
平成28年9月末日	13,425,207,616	-	0.9682	-
10月末日	13,375,836,804	-	1.0088	-
11月末日	14,290,618,288	-	1.1372	-
12月末日	14,425,206,423	-	1.2267	-
平成29年1月末日	14,042,542,519	-	1.2099	-
2月末日	13,779,584,733	-	1.2000	-
第4計算期間末 (平成29年3月21日)	12,458,690,559	13,363,856,649	1.1011	1.1811
3月末日	12,565,365,428	-	1.1006	-
4月末日	12,108,742,837	-	1.0922	-
5月末日	11,495,983,674	-	1.0707	-
6月末日	10,902,379,907	-	1.0667	-
7月末日	10,705,396,190	-	1.0707	-
8月末日	10,153,470,658	-	1.0456	-
9月末日	10,750,432,704	-	1.1326	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.1000
第2計算期間	0.0600
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0800
平成29年3月22日～ 平成29年9月21日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	20.6
第2計算期間	10.7
第3計算期間	12.9
第4計算期間	16.5
平成29年3月22日～ 平成29年9月21日	1.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	20,615,523,383	33,241,717,984
第2計算期間	3,974,318,299	13,935,883,035
第3計算期間	738,626,811	7,654,985,289
第4計算期間	875,132,566	6,531,207,775
平成29年3月22日～ 平成29年9月21日	304,936,507	2,038,229,511

(注) 当初設定数量は46,474,769,158口です。

(参考) 投資信託証券

フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ（適格機関投資家専用）

(1) 投資状況（2017年09月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	9,826,148,709	92.36
内 アメリカ	8,675,650,195	81.55
内 カナダ	785,597,002	7.38
内 オランダ領キュラソー	204,367,211	1.92
内 オランダ	160,534,301	1.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	812,735,790	7.64
純資産総額	10,638,884,499	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	18,770,205	0.18
内 日本	18,770,205	0.18
為替予約取引（売建）	48,772,019	0.46
内 日本	48,772,019	0.46

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

(2) 投資資産（2017年09月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

ア．主要銘柄の明細

	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	株数	簿価単価 簿価金額	評価単価 時価金額	投資 比率
1	CHEVRON CORP	アメリカ・ ドル アメリカ	株式 エネルギー	53,198	12,437.50 661,650,172	13,259.30 705,368,379	6.63%
2	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ・ ドル アメリカ	株式 資本財	223,044	3,423.61 763,615,691	2,732.57 609,484,502	5.73%
3	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ・ ドル アメリカ	株式 公益事業	24,667	14,300.92 352,760,986	16,570.18 408,736,696	3.84%

4	UNION PACIFIC CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	31,224	12,380.00 386,553,388	13,073.29 408,200,659	3.84%
5	CATERPILLAR INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	28,517	11,202.35 319,457,517	14,117.17 402,579,562	3.78%
6	SUNCOR ENERGY INC	カナダ・ドル カナダ	株式 エネルギー	88,724	3,820.76 338,993,970	3,927.78 348,488,698	3.28%
7	FEDEX CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	12,710	21,835.80 277,533,030	25,280.82 321,319,346	3.02%
8	CONCHO RESOURCES INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	19,269	15,788.96 304,237,543	14,863.45 286,403,827	2.69%
9	FORTIVE CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	35,520	6,503.39 231,000,544	7,882.08 279,971,538	2.63%
10	EDISON INTERNATIONAL	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	29,882	8,605.80 257,158,760	8,744.46 261,302,136	2.46%
11	DTE ENERGY COMPANY	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	20,841	11,061.06 230,523,709	12,136.51 252,937,042	2.38%
12	CIMAREX ENERGY CO	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	18,925	14,882.61 281,653,481	12,879.40 243,742,692	2.29%
13	EXELON CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	56,344	4,025.36 226,805,389	4,216.10 237,552,051	2.23%
14	ECOLAB INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 素材	16,136	13,972.88 225,466,448	14,572.60 235,143,588	2.21%
15	KENNAMETAL INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	47,993	4,377.30 210,080,042	4,520.47 216,951,060	2.04%
16	SCOTTS COMPANY-CL A	アメリカ・ドル アメリカ	株式 素材	19,581	10,586.47 207,293,753	10,976.52 214,931,240	2.02%
17	BAKER HUGHES A GE CO LLC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	51,399	6,849.47 352,056,155	4,174.39 214,559,569	2.02%
18	CSX CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	34,901	5,471.91 190,975,277	6,052.47 211,237,384	1.99%
19	MARATHON PETROLEUM CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	33,206	5,638.75 187,240,485	6,253.13 207,641,537	1.95%
20	SCHLUMBERGER LTD	アメリカ・ドル オランダ領 キュラソー	株式 エネルギー	26,213	9,091.67 238,320,063	7,796.40 204,367,211	1.92%

21	MOSAIC CO NEW	アメリカ・ドル アメリカ	株式 素材	81,337	3,786.60 307,990,741	2,401.14 195,302,256	1.84%
22	CMS ENERGY CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	36,976	4,872.19 180,154,119	5,225.03 193,200,912	1.82%
23	HALLIBURTON CO	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	35,463	5,616.26 199,169,546	5,166.41 183,216,607	1.72%
24	KIRBY CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	23,511	8,001.00 188,111,744	7,569.81 177,974,026	1.67%
25	UNITED PARCEL SERVICE INC CL B	アメリカ・ドル アメリカ	株式 運輸	13,176	12,462.09 164,200,610	13,483.63 177,660,378	1.67%
26	PRAXAIR INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 素材	10,929	15,003.40 163,972,211	15,901.69 173,789,611	1.63%
27	NEXTERA ENERGY PARTNERS LP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	36,807	3,470.95 127,755,503	4,521.60 166,426,542	1.56%
28	LYONDELLBASELL INDS CLASS A	アメリカ・ドル オランダ	株式 素材	14,272	10,473.74 149,481,278	11,248.19 160,534,301	1.51%
29	PPL CORPORATION	アメリカ・ドル アメリカ	株式 公益事業	37,035	4,431.56 164,122,930	4,304.03 159,399,802	1.50%
30	TESORO CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 エネルギー	13,789	11,495.83 158,516,047	11,552.57 159,298,393	1.50%

イ．種類別および業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	30.92
		素材	12.79
		資本財	20.68
		運輸	12.19
		公益事業	15.79
	小計		92.36
合計（対純資産総額比）			92.36

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建 / 売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買 / 円売 2017年10月	買建	207,016	18,805,322	18,770,205	0.18%
		アメリカ・ドル売 / 円買 2017年10月	売建	432,744	48,805,321	48,772,019	0.46%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率をいいます。

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

為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) マザーファンド
ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資状況（平成29年9月29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)	67,033,165,097	100.00
純資産総額	67,033,165,097	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29年9月29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。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド パラダイムシフト

2017年9月29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	11,326円
純資産総額	107億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	8.3%
3か月間	6.2%
6か月間	2.9%
1年間	25.5%
3年間	6.5%
5年間	-
設定来	39.3%



※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: 800円

設定来分配金合計額: 2,400円

決算期	第1期 14年3月	第2期 15年3月	第3期 16年3月	第4期 17年3月					
分配金	1,000円	600円	0円	800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。

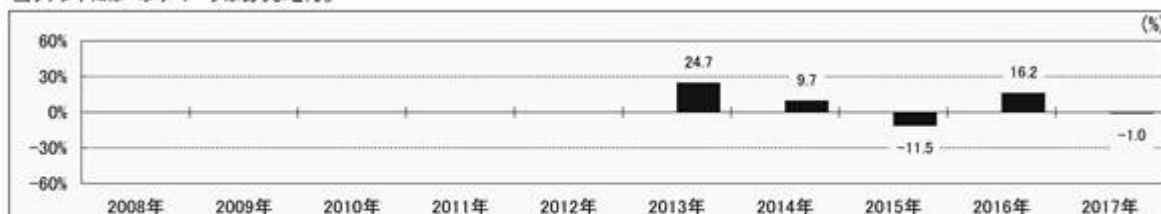
主要な資産の状況

※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
フィデリティ投信	フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ	99.0%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.3%
合計		99.2%

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。

・2013年は設定日(3月19日)から年末、2017年は9月29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。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成29年3月22日から平成29年9月21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。

ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド - パラダイムシフト -

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成29年9月21日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		186,691,311
投資信託受益証券		10,600,871,137
親投資信託受益証券		30,042,199
流動資産合計		10,817,604,647
資産合計		10,817,604,647
負債の部		
流動負債		
未払解約金		31,933,150
未払受託者報酬		1,528,016
未払委託者報酬		67,234,543
その他未払費用		458,331
流動負債合計		101,154,040
負債合計		101,154,040
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,581,283,130
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,135,167,477
（分配準備積立金）		416,555,634
元本等合計		10,716,450,607
純資産合計		10,716,450,607
負債純資産合計		10,817,604,647

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成29年3月22日 至 平成29年9月21日 金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	175,690,961
営業収益合計	175,690,961
営業費用	
支払利息	49,729
受託者報酬	1,528,016
委託者報酬	67,234,543
その他費用	458,845
営業費用合計	69,271,133
営業利益又は営業損失()	106,419,828
経常利益又は経常損失()	106,419,828
中間純利益又は中間純損失()	106,419,828
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	61,066,967
期首剰余金又は期首欠損金()	1,144,114,425
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,526,261
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	29,526,261
剰余金減少額又は欠損金増加額	205,960,004
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	205,960,004
中間剰余金又は中間欠損金()	1,135,167,477

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成29年3月22日 至 平成29年9月21日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成29年9月21日現在
1. 1期首元本額	11,314,576,134円
期中追加設定元本額	304,936,507円
期中一部解約元本額	2,038,229,511円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	9,581,283,130口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成29年3月22日 至 平成29年9月21日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成29年9月21日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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

当中間計算期間末
平成29年9月21日現在

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成29年9月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1185円 (11,185円)

(参考)

当ファンドは、「フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ(適格機関投資家専用)」受益証券を主要投資対象としており、中間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・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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中間計算期間末日(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](#)

「フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ（適格機関投資家専用）」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ファンドの経理状況

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）及び同規則第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）並びに我が国において一般公正妥当と認められる企業会計の基準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。

ファンドは、当監査対象期間（平成28年2月19日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

財務諸表

フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ（適格機関投資家専用）

（1）貸借対照表

区 分	前監査対象期間 平成28年2月18日現在	当監査対象期間 平成29年2月20日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	120,015,982	89,843,515
株式	16,460,471,726	13,487,265,904
派生商品評価勘定	667	533,228
未収入金	-	417,041,421
未収配当金	45,273,675	26,184,497
流動資産合計	16,625,762,050	14,020,868,565
資産合計	16,625,762,050	14,020,868,565
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,684	90
未払解約金	19,999,999	100,000,000
未払受託者報酬	1,810,926	1,297,090
未払委託者報酬	64,129,266	45,933,422
その他未払費用	647,962	625,432
流動負債合計	86,595,837	147,856,034
負債合計	86,595,837	147,856,034
純資産の部		
元本等		
元本	14,598,117,789	9,470,758,037
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,941,048,424	4,402,254,494

(分配準備積立金)	5,830,100,961	4,199,269,746
元本等合計	16,539,166,213	13,873,012,531
純資産合計	16,539,166,213	13,873,012,531
負債純資産合計	16,625,762,050	14,020,868,565

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	前監査対象期間 自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	当監査対象期間 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	478,133,850	330,142,566
受取利息	102,369	506,495
有価証券売買等損益	3,795,266,757	3,853,194,623
為替差損益	843,914,899	394,265,537
営業収益合計	4,160,945,437	3,789,578,147
営業費用		
受託者報酬	4,251,556	2,714,016
委託者報酬	150,557,756	96,110,870
その他費用	4,266,483	2,907,038
営業費用合計	159,075,795	101,731,924
営業利益又は営業損失()	4,320,021,232	3,687,846,223
経常利益又は経常損失()	4,320,021,232	3,687,846,223
当期純利益又は当期純損失()	4,320,021,232	3,687,846,223
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()	404,778,987	559,886,197
期首剰余金又は期首欠損金()	8,804,140,820	1,941,048,424
剰余金増加額又は欠損金減少額	54,322,966	21,634,077
当期追加信託に伴う剰余金増加 額又は欠損金減少額	54,322,966	21,634,077
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,002,173,117	688,388,033
当期一部解約に伴う剰余金減少 額又は欠損金増加額	3,002,173,117	688,388,033
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,941,048,424	4,402,254,494

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における監査対象期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> <p>(2) 監査対象期間の取扱い ファンドの監査対象期間は当期末日および翌日が休日のため、平成28年2月19日から平成29年2月20日までとなっております。</p>
-----------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

項目	前監査対象期間 平成28年2月18日現在	当監査対象期間 平成29年2月20日現在
1. 元本の推移		
期首元本額	21,935,046,553 円	14,598,117,789 円
期中追加設定元本額	145,677,035 円	48,365,923 円
期中一部解約元本額	7,482,605,799 円	5,175,725,675 円
2. 受益権の総数	14,598,117,789 口	9,470,758,037 口
3. 1口当たり純資産額	1.1330 円	1.4648 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前監査対象期間 自 平成27年2月19日 至 平成28年2月18日	当監査対象期間 自 平成28年2月19日 至 平成29年2月20日
<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.30%以内の額</p>	<p>1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 同左</p>
<p>2. 分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(255,183,586円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(151,864,426円)及び分配準備積立金(5,574,917,375円)より分配対象収益は5,981,965,387円(1口当たり0.409776円)ですが、分配は行っておりません。</p>	<p>2. 分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(268,417,888円)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(167,558,833円)、信託約款に規定される収益調整金(202,984,748円)及び分配準備積立金(3,763,293,025円)より分配対象収益は4,402,254,494円(1口当たり0.464826円)ですが、分配は行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 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	<p>当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p>
-----------------	-----------------------------------------------------------------------------

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク等があります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。</p> <p>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よった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前監査対象期間 平成28年 2月18日現在	当監査対象期間 平成29年 2月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	2,526,577,204	2,696,142,843
合 計	2,526,577,204	2,696,142,843

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	前監査対象期間 平成28年 2月18日 現在			当監査対象期間 平成29年 2月20日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1 年 超			うち 1 年 超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	21,960,131	-	21,967,148	7,017	146,684,989	-	146,151,851	533,138
アメリカ・ドル	21,960,131	-	21,967,148	7,017	146,684,989	-	146,151,851	533,138
合計	21,960,131	-	21,967,148	7,017	146,684,989	-	146,151,851	533,138

(注1) 時価の算定方法

1. 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

(1) 予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。

2. 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AGCO CORP	13,948	63.99	892,532.52	
	APACHE CORP	12,848	55.44	712,293.12	
	BAKER HUGHES INC	56,197	60.76	3,414,529.72	
	CMS ENERGY CORP	40,427	43.22	1,747,254.94	
	CSX CORP	50,756	48.54	2,463,696.24	
	CATERPILLAR INC	32,787	98.85	3,240,994.95	

DTE ENERGY COMPANY	33,623	98.12	3,299,088.76	
ECOLAB INC	20,036	123.95	2,483,462.20	
GENERAL DYNAMICS CORPORATION	18,427	189.06	3,483,808.62	
GENERAL ELECTRIC CO	288,135	30.37	8,750,659.95	
WW GRAINGER INC	4,001	254.96	1,020,094.96	
HALLIBURTON CO	26,092	53.71	1,401,401.32	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	18,450	57.61	1,062,904.50	
KENNAMETAL INC	72,997	38.83	2,834,473.51	
MSC INDUSTRIAL DIRECT CO A	17,821	104.57	1,863,541.97	
NEWMONT MINING CORP	50,364	37.01	1,863,971.64	
SCHLUMBERGER LTD	48,878	80.65	3,942,010.70	
SCOTTS COMPANY-CL A	30,430	93.91	2,857,681.30	
UNION PACIFIC CORP	48,195	109.82	5,292,774.90	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	38,236	112.15	4,288,167.40	
EDISON INTERNATIONAL	48,005	76.34	3,664,701.70	
HUBBELL INC	7,294	122.21	891,399.74	
FEDEX CORP	21,295	193.70	4,124,841.50	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,675	192.00	705,600.00	
EXXON MOBIL CORP	23,886	81.76	1,952,919.36	
DEVON ENERGY CORPORATION	38,051	44.17	1,680,712.67	
CHEVRON CORP	70,029	110.33	7,726,299.57	
CONOCOPHILLIPS	29,255	47.51	1,389,905.05	
HESS CORP	37,107	51.75	1,920,287.25	
AGRIUM INC (FIL USD)	21,996	103.65	2,279,885.40	
NEXTERA ENERGY INC	36,514	126.86	4,632,166.04	
MARATHON PETROLEUM CORP	48,207	50.02	2,411,314.14	
UNITED CONTINENTAL HLDGS INC	16,195	75.96	1,230,172.20	
NOW INC W/I	63,270	20.36	1,288,177.20	
NEXTERA ENERGY PARTNERS LP	91,690	30.79	2,823,135.10	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,635	107.63	1,575,165.05	
FORTIVE CORP	50,215	57.69	2,896,903.35	
CIMAREX ENERGY CO	23,365	132.02	3,084,647.30	
LYONDELLBASELL INDS CLASS A	41,394	92.91	3,845,916.54	
CONCHO RESOURCES INC	24,555	140.06	3,439,173.30	
MOSAIC CO NEW	88,929	33.59	2,987,125.11	

アメリカ・ドル 小計		1,722,210		113,465,790.79 (12,808,018,464)	
カナダ・ドル	NEVSUN RESOURCES LTD	254,516	3.95	1,005,338.20	
	SUNCOR ENERGY INC	132,295	42.13	5,573,588.35	
	AFRICA OIL CORP	523,214	2.49	1,302,802.86	
カナダ・ドル 小計		910,025		7,881,729.41 (679,247,440)	
合計		2,632,235		13,487,265,904 (13,487,265,904)	

(イ) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

有価証券明細表注記

1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に関するもので、内書きであります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式	41銘柄	100%	94.96%
カナダ・ドル	株式	3銘柄	100%	5.04%

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワ・マネー・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21日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		68,838,534,658
現先取引勘定		999,998,849
流動資産合計		69,838,533,507
資産合計		69,838,533,507
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	68,541,142,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,297,391,007
元本等合計		69,838,533,507
純資産合計		69,838,533,507
負債純資産合計		69,838,533,507

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3月22日 至 平成29年9月21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。 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9月21日現在
1. 1 期首	平成29年3月22日
期首元本額	67,280,181,778円
期中追加設定元本額	57,587,854,776円
期中一部解約元本額	56,326,894,054円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

ダイワ・グローバルIoT関連株 ファンド - AI新時代 - (為 替ヘッジあり)	9,811,617円
ダイワ・グローバルIoT関連株 ファンド - AI新時代 - (為 替ヘッジなし)	9,811,617円
ダイワFEグローバル・バ リュウ(為替ヘッジあり)	98,069円
ダイワFEグローバル・バ リュウ(為替ヘッジなし)	98,069円
ダイワ/“RICI®”コモ ディティ・ファンド	8,952,508円
US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算 型)	1,676円
US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決算 型)	1,330円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>米ド ルコース	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>円 コース	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>世界 通貨分散コース	981円
DCダイワ・マネー・ポート フォリオ	2,836,142,934円
ダイワファンドラップ コモ ディティセレクト	317,088,630円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 日本円・コース (毎月分配型)	132,757円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 豪ドル・コース (毎月分配型)	643,132円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - ブラジル・レア ル・コース(毎月分配型)	4,401,613円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 米ドル・コース (毎月分配型)	12,784円
ダイワ/フィデリティ北米株 式ファンド - パラダイムシフ ト -	29,484,934円
ブルベア・マネー・ポート フォリオ	29,063,481,625円
ブル3倍日本株ポートフォリオ	28,624,795,753円
ベア2倍日本株ポートフォリオ	7,494,370,446円
ダイワFEグローバル・バ リュウ株ファンド(ダイワS MA専用)	4,090,590円

ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)	155,317円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)	38,024円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)米ドル・コース(毎月分配型)	4,380円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)豪ドル・コース(毎月分配型)	22,592円
ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド	4,974,315円
ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	82,935,047円
ダイワ新興国ハイインカム・プラス - 金積立型 -	501,660円
ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド(償還条項付き)為替ヘッジあり	1,004,378円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース)	33,689円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨コース)	96,254円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジあり)	988,283円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジなし)	4,926,018円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)米ドルコース	13,732,222円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)日本円コース	3,874,449円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)通貨コース	13,437,960円
ダイワ英国高配当株ツイン(毎月分配型)	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	9,134,295円
ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワSMA専用)	382,630円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)南アフリカ・ランド・コース(毎月分配型)	1,097円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)トルコ・リラ・コース(毎月分配型)	2,690円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)通貨セレクト・コース(毎月分配型)	1,350円
ダイワ・オーストラリア高配当株(毎月分配型)株式コース	98,203円

ダイワ・オーストラリア高配当株(毎月分配型)通貨コース	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配当株(毎月分配型)株式&通貨ツインコース	982,029円
ダイワ米国株ストラテジー(通貨選択型) - トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース(毎月分配型)	98,174円
計	68,541,142,500円
2. 期末日における受益権の総数	68,541,142,500口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年9月21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。

(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21日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成29年9月21日現在
1口当たり純資産額	1.0189円
(1万口当たり純資産額)	(10,189円)

2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

【純資産額計算書】

平成29年9月29日

資産総額	10,794,873,514円
負債総額	44,440,810円
純資産総額(-)	10,750,432,704円
発行済数量	9,491,439,917口
1単位当たり純資産額(/)	1.1326円

(参考) フィデリティ・ダイワ・エクイティ・シリーズ(適格機関投資家専用)

純資産額計算書

2017年09月29日

資産総額	11,134,050,076円
負債総額	495,165,577円
純資産総額(-)	10,638,884,499円
発行済数量	7,221,384,944口
1単位当たり純資産額(/)	1.4732円

(参考) ダイワ・マネー・マザーファンド

純資産額計算書

平成29年9月29日

資産総額	67,033,165,097円
負債総額	0円
純資産総額(-)	67,033,165,097円
発行済数量	65,788,648,438口
1単位当たり純資産額(/)	1.0189円

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

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

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成29年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年9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	78	206,158
追加型株式投資信託	707	14,407,986
株式投資信託 合計	785	14,614,143
単位型公社債投資信託	23	121,315
追加型公社債投資信託	14	2,035,351
公社債投資信託 合計	37	2,156,666
総合計	822	16,770,809

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。）。

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

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

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成29年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注）
日の出証券株式会社	4,650	

（注）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

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

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

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月2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/フィデリティ北米株式ファンド - パラダイムシフト - の平成29年3月22日から平成29年9月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド - パラダイムシフト - の平成29年9月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年3月22日から平成29年9月21日まで）の損益の状況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

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。

[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。