

**【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8月9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】** 山村 政  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号**【電話番号】** 03-5555-3111**【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】** 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  
NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円  
コース  
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  
(総称を「NBストラテジック・インカム・ファンド<  
ラップ>」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】** 継続申込期間（平成29年2月10日から平成30年2月9日まで）  
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で30兆円を上  
限とします。**【縦覧に供する場所】** 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成29年2月9日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

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

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

## 4 為替取引の内容の異なる3つのコースがあります。

<略>

### 世界通貨分散コース

<略>



(注) 上記の分散通貨は、2017年5月末現在のものであり、2017年6月以降変更する場合があります。最新の分散通貨については、委託会社のホームページでご確認下さい。

<略>

##### (3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（平成29年5月末日現在）>

<略>

## 2 【投資方針】

## (3) 【運用体制】

&lt;更新後&gt;

&lt;略&gt;

上記の運用体制は平成29年5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】

&lt;更新後&gt;

&lt;略&gt;

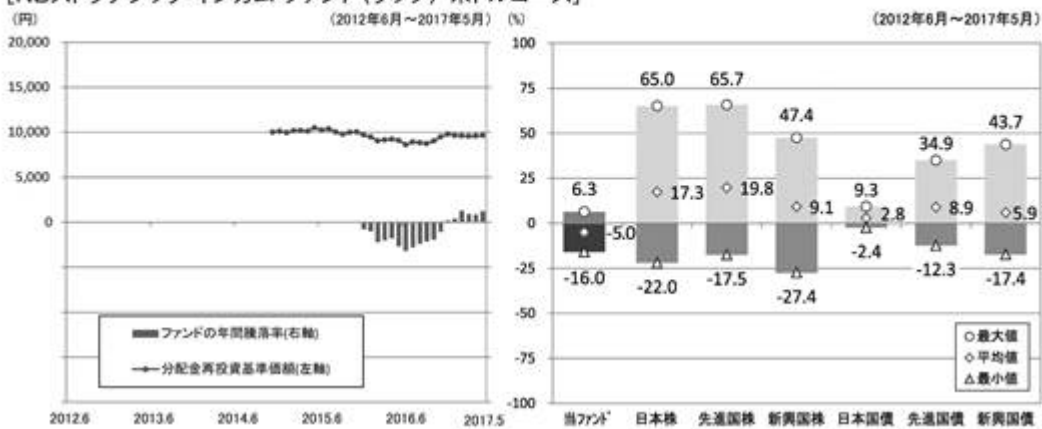
## 参考情報

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

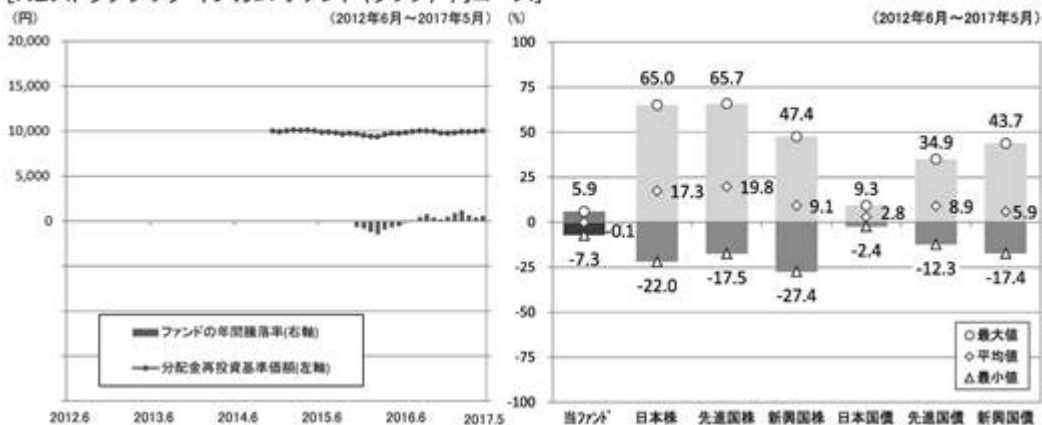
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

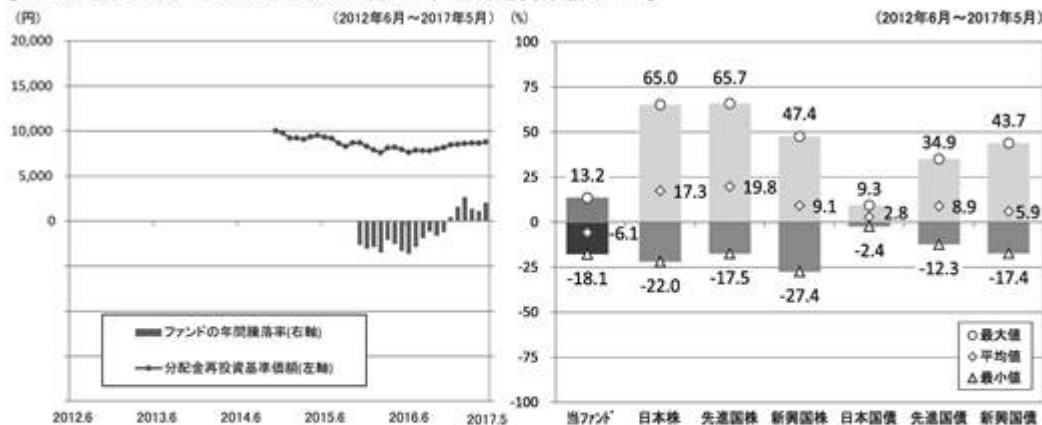
[NBストラテジック・インカム・ファンド(ラップ) 米ドルコース]



[NBストラテジック・インカム・ファンド(ラップ) 円コース]



## 【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】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有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。●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、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 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5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>

【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】

(1) 【投資状況】（平成29年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	137,716,723	99.35
内 ケイマン諸島	137,716,723	99.35
親投資信託受益証券	999	0.00
内 日本	999	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	902,528	0.65
純資産総額	138,620,250	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5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED N1 CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	1,101,469.43	127.09 139,985,968	125.03 137,716,723	99.35
2	ダイワ・マナー・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	981	1.0192 999	1.0191 999	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	99.35%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.35%

(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27年5月18日)	1,011,696	1,011,696	1.0117	1.0117
第2計算期間末 (平成27年11月16日)	93,539,530	93,539,530	1.0022	1.0022
第3計算期間末 (平成28年5月16日)	107,919,608	107,919,608	0.9010	0.9010
平成28年5月末日	109,520,108	-	0.9094	-
6月末日	112,208,536	-	0.8594	-
7月末日	124,905,784	-	0.8913	-
8月末日	130,305,690	-	0.8825	-
9月末日	132,125,967	-	0.8728	-
10月末日	135,577,976	-	0.9019	-
第4計算期間末 (平成28年11月16日)	139,482,643	139,482,643	0.9173	0.9173
11月末日	143,903,644	-	0.9482	-
12月末日	150,248,818	-	0.9783	-
平成29年1月末日	151,757,448	-	0.9638	-
2月末日	156,456,855	-	0.9611	-
3月末日	164,627,457	-	0.9545	-
4月末日	154,641,392	-	0.9581	-
第5計算期間末 (平成29年5月16日)	159,601,728	159,601,728	0.9815	0.9815
5月末日	138,620,250	-	0.9646	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.2
第2計算期間	0.9
第3計算期間	10.1
第4計算期間	1.8

第5計算期間	7.0
--------	-----

## (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	0	0
第2計算期間	94,740,984	2,406,450
第3計算期間	58,521,193	32,076,877
第4計算期間	34,002,278	1,715,141
第5計算期間	30,496,846	19,955,555

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (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5月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	3,640,110,191	5.22
内 日本	3,640,110,191	5.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	66,154,793,482	94.78
純資産総額	69,794,903,673	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5月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	669 国庫短期証券	日本	国債証券	2,850,000,000	100.00 2,850,092,965	100.00 2,850,092,965	- 2017/06/12	4.08
2	667 国庫短期証券	日本	国債証券	410,000,000	100.00 410,005,278	100.00 410,005,278	- 2017/06/05	0.59
3	650 国庫短期証券	日本	国債証券	380,000,000	100.00 380,011,948	100.00 380,011,948	- 2017/06/12	0.54

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	5.22%
合計	5.22%

(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。

**【NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース】**

(1) 【投資状況】（平成29年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	491,659,274	99.52
内 ケイマン諸島	491,659,274	99.52
親投資信託受益証券	999	0.00
内 日本	999	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,377,659	0.48
純資産総額	494,037,932	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5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED N1 CLASS	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	4,557,844.78	107.20 488,631,688	107.87 491,659,274	99.52
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	981	1.0192 999	1.0191 999	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	99.52%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.52%

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

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27年5月18日)	1,005,688	1,005,688	1.0057	1.0057
第2計算期間末 (平成27年11月16日)	102,452,797	102,452,797	0.9661	0.9661
第3計算期間末 (平成28年5月16日)	154,990,166	154,990,166	0.9721	0.9721
平成28年5月末日	157,278,517	-	0.9739	-
6月末日	186,618,999	-	0.9815	-
7月末日	214,278,985	-	0.9940	-
8月末日	242,824,118	-	1.0026	-
9月末日	290,669,625	-	1.0007	-
10月末日	315,401,385	-	0.9958	-
第4計算期間末 (平成28年11月16日)	330,525,920	330,525,920	0.9792	0.9792
11月末日	340,048,581	-	0.9766	-
12月末日	379,686,573	-	0.9753	-
平成29年1月末日	405,589,787	-	0.9812	-
2月末日	455,286,565	-	0.9923	-
3月末日	485,883,392	-	0.9909	-
4月末日	511,125,760	-	0.9943	-
第5計算期間末 (平成29年5月16日)	535,061,783	535,061,783	0.9964	0.9964
5月末日	494,037,932	-	1.0026	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	0.6
第2計算期間	3.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	0.7
第5計算期間	1.8

## (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	0	0
第2計算期間	107,909,320	2,862,189
第3計算期間	84,254,234	30,856,632
第4計算期間	189,842,861	11,731,164
第5計算期間	234,456,550	35,031,728

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネー・マザーファンド

前記「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」の記載と同じ。

**【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】**

## (1) 【投資状況】（平成29年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	16,403,798	99.13
内 ケイマン諸島	16,403,798	99.13
親投資信託受益証券	999	0.01
内 日本	999	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	143,183	0.87
純資産総額	16,547,980	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5月31日現在）

**【投資有価証券の主要銘柄】**

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NB STRATEGIC INCOME FUND GLOBALCURRENCY N1 CLASS	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	183,866.1	90.85 16,705,338	89.21 16,403,798	99.13

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	981	1.0192 999	1.0191 999	0.01
---	-----------------	----	-----------	-----	---------------	---------------	------

(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	99.13%
親投資信託受益証券	0.01%
合計	99.13%

(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27年5月18日)	11,332,293	11,332,293	0.9444	0.9444
第2計算期間末 (平成27年11月16日)	19,022,625	19,022,625	0.8643	0.8643
第3計算期間末 (平成28年5月16日)	18,889,506	18,889,506	0.7934	0.7934
平成28年5月末日	18,920,696	-	0.7947	-
6月末日	18,121,917	-	0.7612	-
7月末日	18,703,132	-	0.7856	-
8月末日	17,334,329	-	0.7814	-
9月末日	16,975,197	-	0.7804	-
10月末日	17,361,963	-	0.7981	-
第4計算期間末 (平成28年11月16日)	15,234,212	15,234,212	0.7922	0.7922
11月末日	15,697,120	-	0.8163	-
12月末日	16,270,440	-	0.8461	-
平成29年1月末日	16,373,073	-	0.8515	-
2月末日	17,149,156	-	0.8601	-
3月末日	17,253,972	-	0.8654	-
4月末日	17,225,605	-	0.8640	-
第5計算期間末 (平成29年5月16日)	17,790,657	17,790,657	0.8923	0.8923

5月末日	16,547,980	-	0.8761	-
------	------------	---	--------	---

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	5.6
第2計算期間	8.5
第3計算期間	8.2
第4計算期間	0.2
第5計算期間	12.6

## (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	0	0
第2計算期間	10,274,835	266,664
第3計算期間	4,200,290	2,400,897
第4計算期間	252,748	4,831,203
第5計算期間	708,389	0

(注) 当初設定数量は12,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネー・マザーファンド

前記「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」の記載と同じ。

[次へ](#)

## (参考情報) 運用実績

## NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;米ドルコース

2017年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,646円
純資産総額	1.3億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	0.7%
3か月間	0.4%
6か月間	1.7%
1年間	6.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	-3.5%

※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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	15年5月	15年11月	16年5月	16年11月	17年5月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0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。

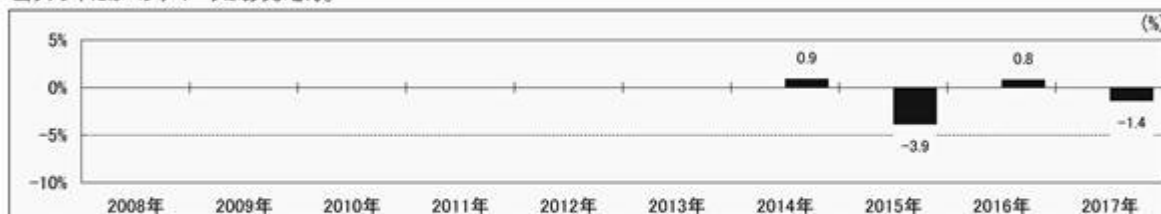
## 主要な資産の状況

※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・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/N1クラス)	99.3%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.0%
合計		99.3%

## 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。  
 ・2014年は設定日(11月28日)から年末、2017年は5月31日までの騰落率を表しています。

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

## (参考情報) 運用実績

## NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;円コース

2017年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,026円
純資産総額	4.9億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	0.8%
3か月間	1.0%
6か月間	2.7%
1年間	2.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	0.3%



※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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 15年5月	第2期 15年11月	第3期 16年5月	第4期 16年11月	第5期 17年5月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0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。

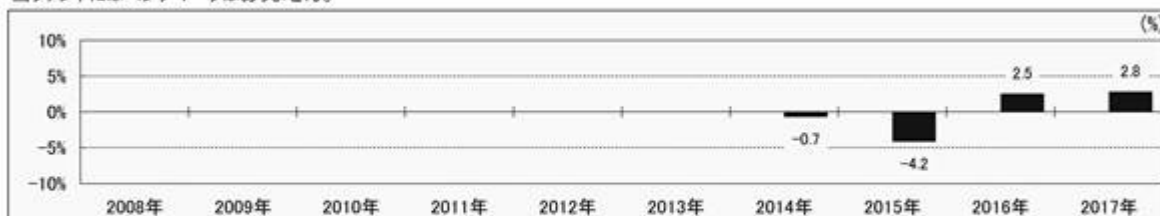
## 主要な資産の状況

※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
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/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/N1クラス)	99.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・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。  
・2014年は設定日(11月28日)から年末、2017年は5月31日までの騰落率を表しています。

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

(参考情報) 運用実績

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

2017年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,761円
純資産総額	16百万円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	1.4%
3か月間	1.9%
6か月間	7.3%
1年間	10.2%
3年間	-
5年間	-
設定来	-12.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円					設定来分配金合計額: 0円				
	第1期 15年5月	第2期 15年11月	第3期 16年5月	第4期 16年11月	第5期 17年5月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0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。

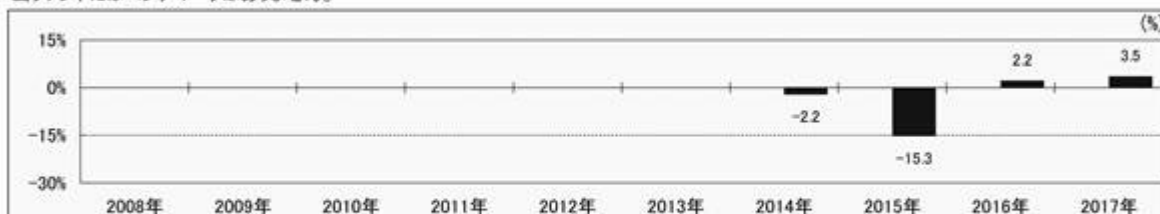
## 主要な資産の状況

※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・パーマニェン・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(通貨分散/N1クラス)	99.1%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・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。  
・2014年は設定日(11月28日)から年末、2017年は5月31日までの騰落率を表しています。

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



## 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

(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、第5期計算期間（平成28年11月17日から平成29年5月16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】

#### 【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】

## 1【財務諸表】

NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;米ドルコース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	974,962	2,359,554
投資信託受益証券	138,802,902	157,603,308
親投資信託受益証券	1,000	999
流動資産合計	139,778,864	159,963,861
資産合計	139,778,864	159,963,861
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	20,282	24,798
未払委託者報酬	270,956	331,215
その他未払費用	4,983	6,120
流動負債合計	296,221	362,133
負債合計	296,221	362,133
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 152,065,987	1 162,607,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 12,583,344	2 3,005,550
（分配準備積立金）	8,487	3,417,632
元本等合計	139,482,643	159,601,728
純資産合計	139,482,643	159,601,728
負債純資産合計	139,778,864	159,963,861

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自	平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,428,327		9,950,405
営業収益合計		3,428,327		9,950,405
営業費用				
支払利息		123		238
受託者報酬		20,282		24,798
委託者報酬		270,956		331,215
その他費用		4,983		6,120
営業費用合計		296,344		362,371
営業利益		3,131,983		9,588,034
経常利益		3,131,983		9,588,034
当期純利益		3,131,983		9,588,034
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（ ）		40,021		448,954
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,859,242		12,583,344
剰余金増加額又は欠損金減少額		175,402		1,534,389
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		175,402		1,534,389
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,071,508		1,095,675
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,071,508		1,095,675
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,583,344		3,005,550

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 平成28年11月17日	至 平成29年5月16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。</p> <p>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。</p> <p>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>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	平成28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
1. 1 期首元本額	119,778,850円	152,065,987円
期中追加設定元本額	34,002,278円	30,496,846円
期中一部解約元本額	1,715,141円	19,955,555円
2. 計算期間末日における受益権の総数	152,065,987口	162,607,278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12,583,344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3,005,550円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0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(1,770,070円)及び分配準備積立金(8,487円)より分配対象額は1,778,557円(1万口当たり116.96円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0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(3,410,117円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,894,321円)及び分配準備積立金(7,515円)より分配対象額は5,311,953円(1万口当たり326.67円)であり、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期
	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	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	第5期
	平成29年5月16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	第4期	第5期
	平成28年11月16日現在	平成29年5月16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）
投資信託受益証券	3,427,737	9,484,602
親投資信託受益証券	0	1
合計	3,427,737	9,484,601

## （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

第4期	第5期
平成28年11月16日現在	平成29年5月16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）

第5期
自 平成28年11月17日
至 平成29年5月16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)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9173円 (9,173円)	0.9815円 (9,815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 N1 CLASS	1,239,770.210	157,603,308	
投資信託受益証券 合計			157,603,308	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネー・マザーファンド	981	999	
親投資信託受益証券 合計			999	
合計			157,604,307	

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/N1クラス)」の受益証券(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・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。

「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/N1クラス)」の状況

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

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(米ドル建て)

貸借対照表  
2016年2月29日

**資産**

投資、公正価値(取得原価 39,829,968ドル)	ドル	37,743,071
現金		225
外貨、公正価値(取得原価 658ドル)		437
為替先渡契約による評価益		757,291
スワップ契約による評価益		123
未収:		
利子		186,031
受益証券の発行		17,187
売却済みの投資		1,083
前払受託会社報酬		12,566
その他資産		6,230
<b>資産合計</b>		<b>38,724,244</b>

**負債**

為替先渡契約による評価損		13,555
金融デリバティブ取引に対する未払追加証拠金		15,333
未払:		
購入済みの投資		8,652,805
専門家報酬		57,577
投資運用会社報酬		40,860
保管報酬		22,636
会計および管理報酬		7,325
名義書換代理会社報酬		1,411
為替仲介会社報酬		449



為替運用会社報酬		253
その他負債		400
<b>負債合計</b>		<b>8,812,604</b>
<b>純資産</b>	<b>ドル</b>	<b>29,911,640</b>
<b>純資産</b>		
通貨セレクトクラス	ドル	2,075,593
通貨分散/N1クラス		152,009
円ヘッジクラス		18,797,532
円ヘッジ/N1クラス		1,800,111
ノンヘッジクラス		3,807,163
ノンヘッジ/N1クラス		3,279,232
	<b>ドル</b>	<b>29,911,640</b>
<b>発行済み受益証券数</b>		
通貨セレクトクラス		3,357,338
通貨分散/N1クラス		224,530
円ヘッジクラス		24,847,229
円ヘッジ/N1クラス		2,021,704
ノンヘッジクラス		3,420,158
ノンヘッジ/N1クラス		3,193,651
<b>1口当りの純資産</b>		
通貨セレクトクラス	ドル	0.618
通貨分散/N1クラス	ドル	0.677
円ヘッジクラス	ドル	0.757
円ヘッジ/N1クラス	ドル	0.890
ノンヘッジクラス	ドル	1.113
ノンヘッジ/N1クラス	ドル	1.027

## 損益計算書

2016年2月29日に終了した年度

<b>投資収益</b>		
利子収入(源泉税22,032ドル控除後)	ドル	899,876
配当収益(源泉税170,611ドル控除後)		398,093
<b>投資収益合計</b>		<b>1,297,969</b>
<b>費用</b>		
投資運用会社報酬		184,675
保管報酬		129,932
専門家報酬		64,611
会計および管理報酬		44,202
名義書換代理会社報酬		14,462
受託会社報酬		12,684
為替運用会社報酬		3,907
為替仲介会社報酬		2,549
登録料		2,156
その他費用		2,800
<b>費用合計</b>		<b>461,978</b>
<b>純投資収益</b>		<b>835,991</b>

実現益および評価益(実現損および評価損):

<b>実現益 (損):</b>	
有価証券への投資	(934,259)
先物取引	25,331
スワップ取引	(4,722)
為替取引および為替先渡契約	(723,857)
<b>純実現損</b>	<b>(1,637,507)</b>
<b>評価益 (損) の純変動:</b>	
有価証券への投資	(1,871,029)
スワップ取引	123
先物取引	(100,919)
為替換算および為替先渡契約	1,280,932
<b>評価損の純変動</b>	<b>(690,893)</b>
<b>純実現・評価損</b>	<b>(2,328,400)</b>
<b>業務活動から生じた純資産の純減</b>	<b>ドル (1,492,409)</b>

(米ドル建て)

投資明細表  
2016年2月29日

	元本金額	有価証券の明細	公正価値
		<b>債券 (93.0%)</b>	
		<b>イタリア (0.7%)</b>	
		<b>国債 (0.7%)</b>	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	
EUR	152,058	2.55% due 09/15/41	ドル 204,704
		<b>国債計</b>	204,704
		<b>イタリア計 (取得原価 205,213ドル)</b>	204,704
		<b>メキシコ (1.7%)</b>	
		<b>国債 (1.7%)</b>	
		Mexican Bonos	
MXN	7,990,000	7.75% due 11/13/42	489,771
		<b>国債計</b>	489,771
		<b>メキシコ計 (取得原価 603,306ドル)</b>	489,771
		<b>オランダ (0.6%)</b>	
		<b>社債 (0.6%)</b>	
		ING Groep NV <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	200,000	6.50% due 12/29/49	181,125
		<b>社債計</b>	181,125
		<b>オランダ計 (取得原価 200,000ドル)</b>	181,125
		<b>ニュージーランド (0.4%)</b>	
		<b>国債 (0.4%)</b>	
		New Zealand Government Bond	
NZD	190,000	2.50% due 09/20/35	130,198
		<b>国債計</b>	130,198
		<b>ニュージーランド計 (取得原価 152,830ドル)</b>	130,198
		<b>南アフリカ (1.1%)</b>	
		<b>国債 (1.1%)</b>	
		South Africa Government Bond	
ZAR	7,835,000	6.50% due 02/28/41	336,830
		<b>国債計</b>	336,830
		<b>南アフリカ計 (取得原価 546,615ドル)</b>	336,830
		<b>スペイン (0.5%)</b>	

		<b>国債 (0.5%)</b>	
		Spain Government Bond <sup>(d)</sup>	
EUR	85,000	5.15% due 10/31/44	138,214
		<b>国債計</b>	138,214
		<b>スペイン計 (取得原価 129,884ドル)</b>	138,214
		<b>スイス (0.6%)</b>	
		<b>社債 (0.6%)</b>	
		UBS Group AG <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	200,000	6.88% due 12/29/49	185,987
		<b>社債計</b>	185,987
		<b>スイス計 (取得原価 197,528ドル)</b>	185,987
		<b>英国 (1.2%)</b>	
		<b>社債 (1.2%)</b>	
		Lloyds Banking Group PLC <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	200,000	7.50% due 04/30/49	187,000
		Royal Bank of Scotland Group PLC <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	200,000	8.00% due 12/29/49	182,500
		<b>社債計</b>	369,500
		<b>英国計 (取得原価 423,751ドル)</b>	369,500
		<b>米国 (86.2%)</b>	
		<b>資産担保証券 (18.8%)</b>	
		Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 Class A4 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	270,000	0.72% due 04/25/36	232,734
		American Airlines Pass-Through Trust Series 2014-1 Class B	
USD	231,734	4.38% due 10/01/22	224,202
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2005-NC5 Class M1 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	280,000	0.92% due 10/25/35	242,327
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 Class A4 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	415,000	0.75% due 01/25/36	343,113
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-RFC1 Class A4 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	415,000	0.68% due 05/25/36	334,504
		Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-OPT3 Class M3 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	700,000	1.16% due 05/25/35	614,071
		COMM Mortgage Trust Series 2013-CR 12 Class XA <sup>(a)</sup>	
USD	1,465,336	1.39% due 10/10/46	102,249
		COMM Mortgage Trust Series 2013-LC6 Class XB <sup>(a),(d)</sup>	
USD	4,000,000	0.36% due 01/10/46	97,600
		COMM Mortgage Trust Series 2014-CR17 Class XA <sup>(a)</sup>	
USD	1,527,217	1.19% due 05/10/47	94,136
		COMM Mortgage Trust Series 2014-UBS3 Class XA <sup>(a)</sup>	
USD	1,272,121	1.34% due 06/10/47	90,508
		CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-Ab1 Class M1 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	145,000	1.07% due 08/25/35	130,275
		GS Mortgage Securities Trust Series 2012-GC6 Class XA <sup>(a),(d)</sup>	
USD	1,387,655	2.05% due 01/10/45	119,229
		GS Mortgage Securities Trust Series 2014-GC18 Class XA <sup>(a)</sup>	
USD	1,560,594	1.26% due 01/10/47	100,254
		JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 Class MV2 <sup>(c),(e)</sup>	
USD	115,000	0.72% due 11/25/36	97,518
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2014-C16 Class XA <sup>(a)</sup>	
USD	1,577,704	1.23% due 06/15/47	102,431

USD	190,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B Class A2D <sup>(c),(e)</sup> 0.84% due 10/25/35	177,601
USD	303,000	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-WCH1 Class M4 <sup>(c),(e)</sup> 1.68% due 01/25/36	272,725
USD	200,000	RAAC Trust Series 2006-SP2 Class M1 <sup>(c),(e)</sup> 0.78% due 02/25/36	177,841
USD	238,889	RAMP Trust Series 2005-RZ1 Class M5 <sup>(c),(e)</sup> 1.07% due 10/25/34	211,856
USD	230,000	RAMP Trust Series 2005-RZ2 Class M4 <sup>(c),(e)</sup> 1.00% due 05/25/35	201,397
USD	385,000	RASC Trust Series 2005-KS10 Class M2 <sup>(c),(e)</sup> 0.88% due 11/25/35	325,787
USD	350,000	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2005-WF4 Class M4 <sup>(c),(e)</sup> 1.02% due 11/25/35	292,690
USD	225,316	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2006-AM1 Class A4 <sup>(c),(e)</sup> 0.60% due 04/25/36	211,844
USD	614,297	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2006-BC5 Class A4 <sup>(c),(e)</sup> 0.61% due 12/25/36	531,695
USD	1,242,786	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust Series 2012-C4 Class XA <sup>(a),(d)</sup> 1.81% due 12/10/45	106,028
USD	3,299,458	WFRBS Commercial Mortgage Trust Series 2013-C11 Class XA <sup>(a),(d)</sup> 1.47% due 03/15/45	192,731
		<b>資産担保証券計</b>	<b>5,627,346</b>
		<b>社債 (22.2%)</b>	
USD	190,000	Air Lease Corp. <sup>(c)</sup> 3.88% due 04/01/21	183,825
USD	220,000	Ally Financial, Inc. 3.25% due 02/13/18	217,800
USD	60,000	Anadarko Petroleum Corp. <sup>(c)</sup> 3.45% due 07/15/24	48,629
USD	205,000	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. <sup>(c)</sup> 3.65% due 02/01/26	211,605
USD	275,000	4.90% due 02/01/46	294,688
USD	65,000	Apache Corp. <sup>(c)</sup> 4.75% due 04/15/43	49,700
USD	175,000	AT&T, Inc. 4.75% due 05/15/46 <sup>(c)</sup>	159,742
USD	240,000	5.35% due 09/01/40	233,630
USD	245,000	Bank of America Corp. <sup>(a),(b),(c)</sup> 6.10% due 12/29/49	237,650
USD	165,000	CCO Safari II LLC <sup>(c),(d)</sup> 4.91% due 07/23/25	169,274
USD	150,000	6.48% due 10/23/45	158,163
USD	230,000	Citigroup, Inc. <sup>(a),(b),(c)</sup> 5.95% due 12/29/49	216,200
USD	150,000	Corporate Office Properties LP <sup>(c)</sup> 3.70% due 06/15/21	148,283
USD	40,000	Education Realty Operating Partnership LP <sup>(c)</sup> 4.60% due 12/01/24	40,173

		Energy Transfer Partners LP <sup>(c)</sup>	
USD	150,000	6.50% due 02/01/42	121,231
		EPR Properties <sup>(c)</sup>	
USD	150,000	5.75% due 08/15/22	160,263
		General Electric Co. <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	164,000	5.00% due 12/29/49	166,460
		General Motors Co. <sup>(c)</sup>	
USD	90,000	6.75% due 04/01/46	94,145
		Glencore Funding LLC <sup>(d)</sup>	
USD	85,000	2.88% due 04/16/20	70,763
USD	165,000	4.00% due 04/16/25	118,800
		Goldman Sachs Group, Inc. <sup>(b)</sup>	
USD	130,000	5.15% due 05/22/45	123,941
USD	335,000	5.70% due 12/29/49 <sup>(a),(c)</sup>	320,762
		Hewlett Packard Enterprise Co. <sup>(c),(d)</sup>	
USD	150,000	4.90% due 10/15/25	142,357
USD	220,000	6.35% due 10/15/45	187,612
		JPMorgan Chase & Co. <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	280,000	6.00% due 12/29/49	277,200
		Kinder Morgan Energy Partners LP	
USD	75,000	5.50% due 03/01/44 <sup>(c)</sup>	61,191
USD	145,000	6.50% due 09/01/39	123,047
		Kinder Morgan, Inc. <sup>(c)</sup>	
USD	70,000	5.55% due 06/01/45	58,111
		Marathon Oil Corp. <sup>(c)</sup>	
USD	165,000	3.85% due 06/01/25	113,562
		Morgan Stanley <sup>(b)</sup>	
USD	170,000	3.95% due 04/23/27	164,196
USD	240,000	5.45% due 07/29/49 <sup>(a),(c)</sup>	224,400
		Omega Healthcare Investors, Inc. <sup>(c)</sup>	
USD	190,000	4.50% due 01/15/25	187,955
		Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp. <sup>(c)</sup>	
USD	80,000	4.65% due 10/15/25	67,278
		Prudential Financial, Inc. <sup>(a),(c)</sup>	
USD	165,000	5.20% due 03/15/44	154,894
USD	140,000	5.38% due 05/15/45	131,950
		Qwest Corp.	
USD	130,000	6.75% due 12/01/21	138,450
		Seagate HDD Cayman	
USD	135,000	4.75% due 06/01/23	109,084
USD	110,000	4.88% due 06/01/27 <sup>(d),(c)</sup>	76,264
		Verizon Communications, Inc.	
USD	259,000	4.67% due 03/15/55	228,738
		Viacom, Inc. <sup>(c)</sup>	
USD	95,000	5.25% due 04/01/44	74,594
		Voya Financial, Inc. <sup>(a),(c)</sup>	
USD	175,000	5.65% due 05/15/53	162,521
		Wells Fargo & Co. <sup>(a),(b),(c)</sup>	
USD	245,000	5.90% due 12/29/49	245,000
		Williams Partners LP <sup>(c)</sup>	
USD	225,000	3.60% due 03/15/22	176,674
		<b>社債計</b>	<b>6,650,805</b>

**国債 (45.2%)**

		Federal Home Loan Mortgage Corp., TBA <sup>(f)</sup>	
USD	405,000	3.00% due 03/01/31	422,617
USD	310,000	3.50% due 03/01/46	324,113
USD	1,670,000	4.00% due 03/01/46	1,779,496
USD	460,000	4.50% due 03/15/46	498,669
		Federal National Mortgage Association, TBA <sup>(f)</sup>	
USD	110,000	3.00% due 03/01/31	114,705
USD	300,000	3.50% due 03/01/46	314,312
USD	2,085,000	4.00% due 03/01/46	2,224,841
USD	1,510,000	4.50% due 03/01/46	1,639,968
		Government National Mortgage Association, TBA <sup>(f)</sup>	
USD	515,000	3.50% due 03/01/46	543,808
USD	740,000	4.00% due 03/01/46	790,225
		U. S. Treasury Bill*	
USD	500,000	0.17% due 07/21/16	499,665
		U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds	
USD	198,883	0.75% due 02/15/42	185,929
USD	949,588	3.88% due 04/15/29	1,334,369
		U.S. Treasury Inflation Indexed Note	
USD	444,381	0.25% due 01/15/25	441,309
		U.S. Treasury Note	
USD	400,000	0.50% due 03/31/17	399,078
USD	2,000,000	0.50% due 04/30/17	1,994,688
		<b>国債計</b>	<b>13,507,792</b>
		<b>米国計 (取得原価 26,466,920ドル)</b>	<b>25,785,943</b>
		<b>債券計 (取得原価 28,926,047ドル)</b>	<b>27,822,272</b>

**口数****上場投資信託 (29.1%)****米国 (29.1%)**

36,120	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	2,892,490
10,000	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	1,073,800
44,709	PowerShares Senior Loan Portfolio	988,963
70,910	SPDR Barclays High Yield Bond ETF	2,369,812
54,200	SPDR Barclays Short Term High Yield Bond ETF	1,371,802
	<b>米国計</b>	<b>8,696,867</b>
	<b>上場投資信託計 (取得原価 9,669,556ドル)</b>	<b>8,696,867</b>

**元本金額****短期投資 (4.1%)****グランド・ケイマン (0.1%)****定期預金 (0.1%)**

Brown Brothers Harriman &amp; Co.

EUR	2,806	(0.31)% due 03/01/16	3,049
JPY	46,768	(0.13)% due 03/01/16	414
CAD	54	0.05% due 03/01/16	40
GBP	6	0.08% due 03/01/16	8
AUD	901	0.98% due 03/01/16	644
NZD	81	1.35% due 03/01/16	53
ZAR	260,118	6.15% due 03/01/16	16,479
		<b>定期預金計</b>	<b>20,687</b>
		<b>グランド・ケイマン計 (取得原価 31,120ドル)</b>	<b>20,687</b>

**ノルウェー (4.0%)****定期預金 (4.0%)**

DnB NORD Bank ASA

USD	1,203,245	0.15% due 03/01/16	1,203,245
		<b>定期預金計</b>	<b>1,203,245</b>
		<b>ノルウェー計 (取得原価 1,203,245ドル)</b>	<b>1,203,245</b>

短期投資計(取得原価 1,234,365ドル)

1,223,932

投資計(取得原価 39,829,968ドル)

現金およびその他資産を上回る負債

純資産

対純資産

比率

126.2% ドル 37,743,071

(26.2)% (7,831,431)

100.0% ドル 29,911,640

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良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せん。

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。

(a) 2016年2月29日時点の変動金利証券。

(b) 永久債。

(c) 償還条項付き証券。

(d) 144A証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関購入者に転売が可能です。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。

(e) 2016年2月29日時点の変動利付き証券。

(f) 発行日取引または繰延受渡しベースで購入された証券。

## 2016年2月29日時点の先物取引(純資産の(0.14)%)

ポジション	銘柄	限月	枚数	評価益/(損)
売り	10 Year Mini SGX Japanese Government Bond March Futures	2016年3月	(13)	ドル (40,425)
売り	10 Year USD Deliverable Interest Rate Swap March Futures	2016年3月	(4)	(1,638)
買い	Bank Accept June Futures	2017年6月	21	(3,345)
売り	British Pound March Futures	2016年3月	(1)	6,594
売り	Euro Buxl 30 Year Bond June Futures	2016年3月	(5)	(72,364)
売り	Euro FX March Futures	2016年3月	(1)	1,437
売り	Mexican Peso March Futures	2016年3月	(6)	8,148
買い	New Zealand 90 Day Bank Bill December Futures	2016年12月	12	10,818
売り	New Zealand Dollar March Futures	2016年3月	(1)	605
売り	South African Rand (CME) March Futures	2016年3月	(7)	19,250
売り	U.S. Treasury 10 Year Note (CBT) June Futures	2016年6月	(37)	25,728
売り	U.S. Treasury 2 Year Note (CBT) June Futures	2016年6月	(11)	1,598
売り	U.S. Treasury 5 Year Note (CBT) June Futures	2016年6月	(20)	5,533
買い	U.S. Treasury Long Bond (CBT) June Futures	2016年6月	2	(1,139)
買い	U.S. Treasury Ultra Bond (CBT) June Futures	2016年6月	5	228
買い	U.S. Treasury Ultra Bond (CBT) June Futures	2016年6月	5	(3,838)
				ドル (42,810)

## 2016年2月29日時点の通貨セレクトクラス為替先渡契約(純資産の(0.01)%)

買い	カウンターパーティ	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.	1,522,957	2016年3月10日	USD	388,407	ドル -	ドル (6,590)	ドル (6,590)
CLP	Citibank N.A.	218,804,901	2016年3月10日	USD	312,259	2,390	-	2,390
CNY	Citibank N.A.	1,943,793	2016年3月10日	USD	296,263	514	-	514
IDR	Citibank N.A.	5,006,516,603	2016年3月10日	USD	365,575	8,354	-	8,354
INR	Citibank N.A.	25,488,075	2016年3月10日	USD	374,827	-	(2,933)	(2,933)
TRY	Citibank N.A.	1,107,762	2016年3月10日	USD	378,044	-	(4,032)	(4,032)
						ドル 11,258	ドル (13,555)	ドル (2,297)

## 2016年2月29日時点の円ヘッジクラス為替先渡契約(純資産の2.28%)

買い	カウンターパーティ	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.	2,106,730,696	2016年3月10日	USD	17,986,237	ドル	681,138	ドル	-	ドル	681,138

## 2016年2月29日時点の円ヘッジ/N1クラス為替先渡契約(純資産の0.22%)

買い	カウンターパーティ	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.	202,349,515	2016年3月10日	USD	1,728,094	ドル	64,895	ドル	-	ドル	64,895

## 2016年2月29日時点の通貨分散/N1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	参照法人	カウンターパーティ	通貨	満期日	公正価値
149,902	Nomura 12 Currency Basket Strategy	Nomura Securities Co., Ltd.	USD	2016年3月31日	ドル 123

## 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
CNY	-	中国元
CLP	-	チリ・ペソ
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
KRW	-	韓国ウォン
MXN	-	メキシコ・ペソ
NZD	-	ニュージーランド・ドル
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

## 「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28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	54,321,228,735	63,687,932,599
国債証券	12,590,323,852	10,330,405,180



現先取引勘定		999,999,972	999,998,849
流動資産合計		67,911,552,559	75,018,336,628
資産合計		67,911,552,559	75,018,336,628
負債の部			
流動負債			
未払金		2,210,019,580	-
未払解約金		-	2,500,213,000
その他未払費用		-	19,494
流動負債合計		2,210,019,580	2,500,232,494
負債合計		2,210,019,580	2,500,232,494
純資産の部			
元本等			
元本	1	64,447,005,661	71,154,904,977
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,254,527,318	1,363,199,157
元本等合計		65,701,532,979	72,518,104,134
純資産合計		65,701,532,979	72,518,104,134
負債純資産合計		67,911,552,559	75,018,336,628

## 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28年11月17日 至 平成29年5月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
1. 1 期首	平成28年5月17日	平成28年11月17日
期首元本額	51,965,391,476円	64,447,005,661円
期中追加設定元本額	114,135,646,315円	89,284,035,210円
期中一部解約元本額	101,654,032,130円	82,576,135,894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)	- 円	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)	- 円	9,811,617円
ダイワFEグローバル・バリュー(為替ヘッジあり)	98,069円	98,069円
ダイワFEグローバル・バリュー(為替ヘッジなし)	98,069円	98,069円
ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド	8,952,508円	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)	740,564円	740,564円
US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)	1,623,350円	1,623,350円
スマート・アロケーション・Dガード	35,931,339円	- 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	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	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	981円
堅実バランスファンド - ハジメの一步 -	235,600,789円	86,792,847円
DCダイワ・マネー・ポートフォリオ	2,405,601,530円	2,792,621,667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	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	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	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	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	12,784円
ダイワノフィデリティ北米株 式ファンド - パラダイムシ フト - (適格機関投資家専用)ス マート・シックス・Dガード ブルベア・マネー・ポート フォリオ	29,484,934円	29,484,934円
ブル3倍日本株ポートフォリ オ	962,962,237円	- 円
ベア2倍日本株ポートフォリ オ	22,510,611,569円	31,865,399,028円
ダイワFEグローバル・バ リュ株ファンド(ダイワS MA専用)	32,256,094,607円	29,311,348,940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)	5,041,254,199円	6,316,620,085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)	4,090,590円	4,090,590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)	98,290,744円	98,290,744円
	23,590,527円	23,590,527円
	2,163,360円	2,163,360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)	13,761,552円	13,761,552円
ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド	4,974,315円	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	144,657,409円	124,468,436円
ダイワ新興国ハイインカム・プラス - 金積立型 -	501,660円	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	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)	49,082,149円	33,689円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨コース)	196,290,094円	96,254円
ダイワ・ダブルバランス・ファンド(Dガード付/部分為替ヘッジあり)	51,617,460円	- 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	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	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	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	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	13,437,960円
ダイワ英国高配当株ツイン(毎月分配型)	98,107円	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円	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	1,729,852円	83,883,091円
DCスマート・アロケーション・Dガード	1,338,892円	- 円
ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワSMA専用)	313,861円	98,032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）	98,252円	98,252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）	2,554,212円	2,554,212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）	1,178,976円	1,178,976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	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	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	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	98,174円
計	64,447,005,661円	71,154,904,977円
2. 期末日における受益権の総数	64,447,005,661口	71,154,904,977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28年11月17日 至 平成29年5月16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29年5月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	99,458	419,110
合計	99,458	419,110

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年12月10日から平成28年11月16日まで、及び平成28年12月10日から平成29年5月16日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成28年11月16日現在	平成29年5月16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28年11月16日現在	平成29年5月16日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0195円 (10,195円)	1.0192円 (10,192円)
---------------------------	----------------------	----------------------

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	6 5 0 国庫短期証券	380,000,000	380,026,828	
	6 6 5 国庫短期証券	4,420,000,000	4,420,068,176	
	6 6 6 国庫短期証券	2,270,000,000	2,270,080,008	
	6 6 7 国庫短期証券	410,000,000	410,021,088	
	6 6 9 国庫短期証券	2,850,000,000	2,850,209,080	
国債証券 合計			10,330,405,180	
合計			10,330,405,180	

### 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。

【NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース】

(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、第5期計算期間（平成28年11月17日から平成29年5月16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】

NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;円コース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,642,521	5,999,424
投資信託受益証券	328,450,593	530,067,777
親投資信託受益証券	1,000	999
流動資産合計	331,094,114	536,068,200
資産合計		
	331,094,114	536,068,200
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	38,931	68,974
未払委託者報酬	519,608	920,278
その他未払費用	9,655	17,165
流動負債合計	568,194	1,006,417
負債合計		
	568,194	1,006,417
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 337,556,430	1 536,981,252
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 7,030,510	2 1,919,469
（分配準備積立金）	763,030	7,338,216
元本等合計	330,525,920	535,061,783
純資産合計		
	330,525,920	535,061,783
負債純資産合計		
	331,094,114	536,068,200

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自	平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		776,329		9,217,183
営業収益合計		776,329		9,217,183
営業費用				
支払利息		627		1,402
受託者報酬		38,931		68,974
委託者報酬		519,608		920,278
その他費用		9,655		17,185
営業費用合計		568,821		1,007,839
営業利益又は営業損失（ ）		1,345,150		8,209,344
経常利益又は経常損失（ ）		1,345,150		8,209,344
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,345,150		8,209,344
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		197,610		155,025
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,454,567		7,030,510
剰余金増加額又は欠損金減少額		289,267		730,152
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		289,267		730,152
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,322,450		3,673,430
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,322,450		3,673,430
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,030,510		1,919,469

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 平成28年11月17日	至 平成29年5月16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>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	平成28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
1. 1 期首元本額	159,444,733円	337,556,430円
期中追加設定元本額	189,842,861円	234,456,550円
期中一部解約元本額	11,731,164円	35,031,728円
2. 計算期間末日における受益権の総数	337,556,430口	536,981,252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7,030,510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1,919,469円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0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(2,856,217円)及び分配準備積立金(763,030円)より分配対象額は3,619,247円(1万口当たり107.22円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0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(6,636,114円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,054,997円)及び分配準備積立金(702,102円)より分配対象額は12,393,213円(1万口当たり230.79円)であり、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期
	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	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	第5期
	平成29年5月16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	第4期	第5期
	平成28年11月16日現在	平成29年5月16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）
投資信託受益証券	896,798	9,135,169
親投資信託受益証券	0	1
合計	896,798	9,135,168

## （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

第4期	第5期
平成28年11月16日現在	平成29年5月16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）

第5期
自 平成28年11月17日
至 平成29年5月16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)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9792円 (9,792円)	0.9964円 (9,964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 N1 CLASS	4,944,754.360	530,067,777	
投資信託受益証券 合計			530,067,777	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネー・マザーファンド	981	999	
親投資信託受益証券 合計			999	
合計			530,068,776	

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/N1クラス)」の受益証券(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・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。

「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/N1クラス)」の状況

前記「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」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の状況

前記「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」に記載のとおりであります。

【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】

(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、第5期計算期間（平成28年11月17日から平成29年5月16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】

NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;世界通貨分散コース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	164,699	121,405
投資信託受益証券	15,110,820	17,707,202
親投資信託受益証券	1,000	999
流動資産合計	15,276,519	17,829,606
資産合計	15,276,519	17,829,606
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	2,860	2,631
未払委託者報酬	38,802	35,775
その他未払費用	645	543
流動負債合計	42,307	38,949
負債合計	42,307	38,949
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 19,229,109	1 19,937,498
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 3,994,897	2 2,146,841
元本等合計	15,234,212	17,790,657
純資産合計	15,234,212	17,790,657
負債純資産合計	15,276,519	17,829,606

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自	平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		44,561		1,996,381
営業収益合計		44,561		1,996,381
営業費用				
受託者報酬		2,860		2,631
委託者報酬		38,802		35,775
その他費用		645		543
営業費用合計		42,307		38,949
営業利益又は営業損失（ ）		86,868		1,957,432
経常利益又は経常損失（ ）		86,868		1,957,432
当期純利益又は当期純損失（ ）		86,868		1,957,432
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		65,988		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,918,058		3,994,897
剰余金増加額又は欠損金減少額		998,306		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		998,306		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		54,265		109,376
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		54,265		109,376
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,994,897		2,146,841

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 平成28年11月17日	至 平成29年5月16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。</p> <p>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。</p> <p>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>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	平成28年11月16日現在	平成29年5月16日現在
1. 1 期首元本額	23,807,564円	19,229,109円
期中追加設定元本額	252,748円	708,389円
期中一部解約元本額	4,831,203円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	19,229,109口	19,937,498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3,994,897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2,146,841円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 平成28年5月17日 至 平成28年11月16日	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16日
1 分配金の計算過程	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（0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（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。	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（0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（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。

## （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	第5期
	自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16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	第5期 平成29年5月16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	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16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）
投資信託受益証券	39,395	1,996,381
親投資信託受益証券	0	1
合計	39,395	1,996,380

## (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

第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16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)

第5期 自 平成28年11月17日 至 平成29年5月16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)

	第4期 平成28年11月16日現在	第5期 平成29年5月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7922円 (7,922円)	0.8923円 (8,923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 GLOBALCURRENCY N1 CLASS	194,893.040	17,707,202	
投資信託受益証券 合計			17,707,202	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネー・マザーファンド	981	999	
親投資信託受益証券 合計			999	
合計			17,708,201	

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(通貨分散/N1クラス)」の受益証券(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・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。

「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(通貨分散/N1クラス)」の状況

前記「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」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の状況

前記「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」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>

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

【純資産額計算書】

平成29年5月31日

資産総額	140,247,256円
負債総額	1,627,006円
純資産総額（ - ）	138,620,250円
発行済数量	143,705,716口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9646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5月31日

資産総額	69,873,891,167円
負債総額	78,987,494円
純資産総額（ - ）	69,794,903,673円
発行済数量	68,484,940,115口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0191円

NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース

純資産額計算書

平成29年5月31日

資産総額	495,133,341円
負債総額	1,095,409円
純資産総額（ - ）	494,037,932円
発行済数量	492,765,483口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0026円

(参考) ダイワ・マネー・マザーファンド

前記「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」の記載と同じ。



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

## 純資産額計算書

平成29年5月31日

資産総額	16,551,200円
負債総額	3,220円
純資産総額（ - ）	16,547,980円
発行済数量	18,888,465口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8761円

(参考) ダイワ・マネー・マザーファンド

前記「NBストラテジック・インカム・ファンド&lt;ラップ&gt;米ドルコース」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

平成29年5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5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	74	205,390
追加型株式投資信託	688	13,488,992
株式投資信託 合計	762	13,694,382
単位型公社債投資信託	17	106,757
追加型公社債投資信託	14	2,117,421
公社債投資信託 合計	31	2,224,177
総合計	793	15,918,559

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

<訂正後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（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。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (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
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185

長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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	2
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		

利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	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	利益剰余金	
				剰余金		
		繰越利益				
		剰余金				
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 その他有価証券	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 その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 その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．その他有価証券

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		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)	
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		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)	
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 (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)
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的主要原因別内訳

(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)
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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

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。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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

## 第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
いちよし証券株式会社	14,577	（注）

（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ないます。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ないます。

### 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。

### 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>

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

<略>

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月23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>米ドルコースの平成28年11月17日から平成29年5月16日までの計算期間の財務諸表、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、NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコースの平成29年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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29年6月23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NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コースの平成28年11月17日から平成29年5月16日までの計算期間の財務諸表、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、NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コースの平成29年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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29年6月23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の平成28年11月17日から平成29年5月16日までの計算期間の財務諸表、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、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の平成29年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。