

【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5月31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
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】 ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）
ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）
（総称を「ダイワ債券コア戦略ファンド」とします。）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続申込期間（平成28年12月1日から平成29年11月30日まで）
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で20兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年11月30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。

第一部 【証券情報】

(5) 【申込手数料】

<更新後>

<略>

<スイッチング（乗換え）について>

<略>

- ・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

<略>

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>

3 <略>

〈グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLCについて〉

- グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLCは1,632億米ドル(約18.2兆円)の資産を運用する運用会社であり、米国サンタモニカを本拠地としています。
- 同社は、米国の金融グループであるグッゲンハイム・パートナーズの運用会社として設立されました。
- グッゲンハイム・パートナーズは、世界6カ国において各種金融サービスを提供し、運用業務、証券業務、保険関連業務を行なう会社を有します。

(2017年3月末現在)

<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3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3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>

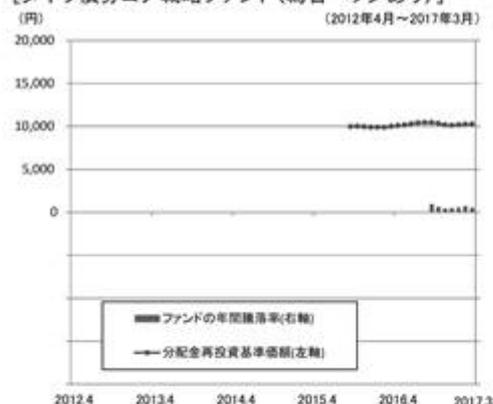
< 略 >

参考情報

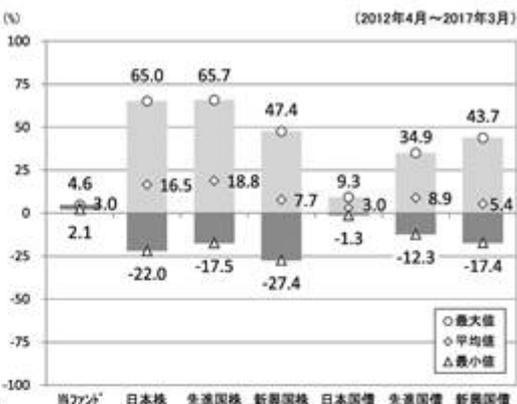
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

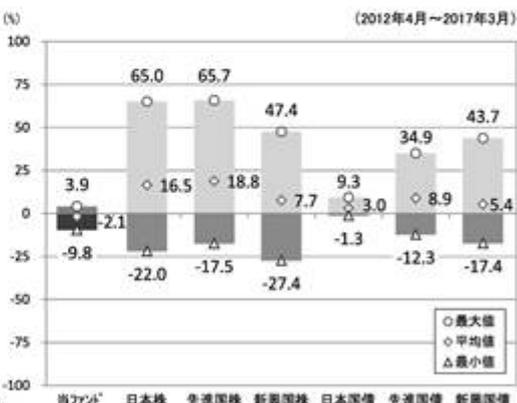
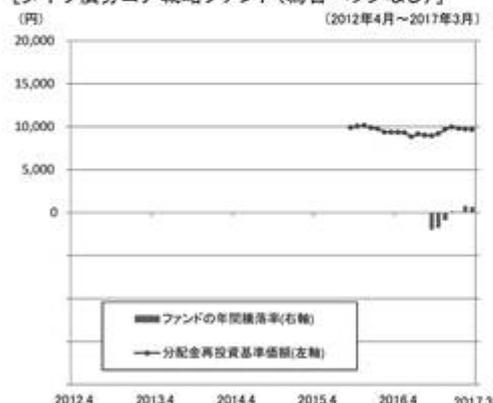
【ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)】



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)】



※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】

(1) 【申込手数料】

<更新後>

<略>

<スイッチング（乗換え）について>

<略>

- ・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

<略>

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

() 上記は、平成29年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

5 【運用状況】

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

<訂正後>

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】（平成29年3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	8,575,794,581	99.44
内 ケイマン諸島	8,575,794,581	99.44
親投資信託受益証券	1,000	0.00
内 日本	1,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	48,514,865	0.56
純資産総額	8,624,310,446	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3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	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	86,584,830.95	98.64 8,541,063,992	99.04 8,575,794,581	99.44
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	999	1.0014 1,000	1.0014 1,000	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	99.44%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.44%

(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28年3月7日)	3,500,167,507	3,546,688,689	0.9781	0.9911
平成28年3月末日	3,524,612,182	-	0.9858	-
4月末日	3,596,661,307	-	0.9937	-
5月末日	3,891,814,199	-	1.0005	-
6月末日	4,530,669,272	-	1.0142	-
7月末日	4,783,679,766	-	1.0258	-
8月末日	5,556,877,863	-	1.0295	-
第2計算期間末 (平成28年9月7日)	5,866,743,939	5,935,914,686	1.0178	1.0298
9月末日	6,232,445,687	-	1.0176	-
10月末日	7,311,981,308	-	1.0071	-
11月末日	7,703,001,639	-	0.9913	-
12月末日	8,183,916,769	-	0.9867	-
平成29年1月末日	8,475,780,220	-	0.9915	-
2月末日	8,708,987,109	-	0.9985	-
第3計算期間末 (平成29年3月7日)	8,784,842,995	8,865,051,860	0.9857	0.9947
3月末日	8,624,310,446	-	0.9889	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0130
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0090

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	5.3
第3計算期間	2.3

(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	2,095,155,807	61,309,356
第2計算期間	2,489,519,247	303,842,776
第3計算期間	4,531,648,102	1,383,780,914

(注) 当初設定数量は1,544,706,029口です。

(参考) マザーファンド
 ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

(1) 投資状況（平成29年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,342,249,387	100.00
純資産総額	10,342,249,387	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3月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

該当事項はありません。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】（平成29年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,649,101,246	99.51
内 ケイマン諸島	1,649,101,246	99.51
親投資信託受益証券	1,000	0.00
内 日本	1,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,091,617	0.49
純資産総額	1,657,193,863	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3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	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	17,790,041.27	94.12 1,674,514,001	92.69 1,649,101,246	99.51
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	999	1.0014 1,000	1.0014 1,000	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	99.51%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.51%

(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28年3月7日)	1,939,979,861	1,967,243,188	0.9250	0.9380
平成28年3月末日	1,954,817,732	-	0.9225	-
4月末日	1,950,942,797	-	0.9214	-
5月末日	1,938,365,888	-	0.9168	-
6月末日	1,900,731,704	-	0.8711	-
7月末日	1,936,887,096	-	0.9011	-
8月末日	1,956,503,581	-	0.8879	-
第2計算期間末 (平成28年9月7日)	1,937,466,409	1,959,639,026	0.8738	0.8838
9月末日	1,827,591,194	-	0.8701	-
10月末日	1,882,548,090	-	0.8939	-
11月末日	1,885,521,435	-	0.9433	-

12月末日	1,637,629,516	-	0.9704	-
平成29年1月末日	1,506,827,184	-	0.9546	-
2月末日	1,493,885,156	-	0.9479	-
第3計算期間末 (平成29年3月7日)	1,589,593,221	1,609,748,474	0.9464	0.9584
3月末日	1,657,193,863	-	0.9303	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0130
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	4.5
第3計算期間	9.7

(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	893,624,546	16,872,238
第2計算期間	321,078,931	200,996,226
第3計算期間	524,592,394	1,062,249,649

(注) 当初設定数量は1,220,426,710口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)」の記載と同じ。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

2017年3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	9,889円
純資産総額	86億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.1%
3カ月間	1.1%
6カ月間	-1.9%
1年間	2.4%
3年間	-
5年間	-
設定来	2.3%



※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: 210円 設定来分配金合計額: 340円

決算期	第1期 16年3月	第2期 16年9月	第3期 17年3月						
分配金	130円	120円	90円						

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の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。

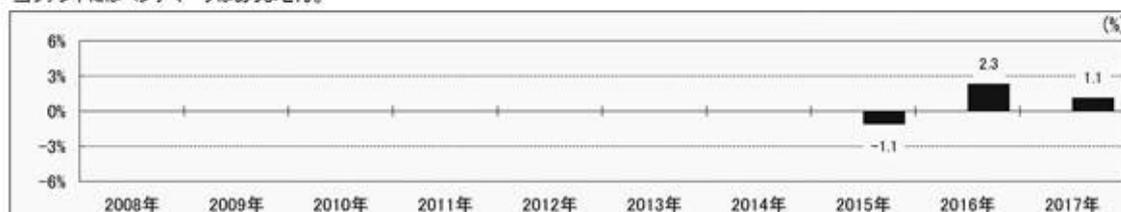
主要な資産の状況

※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
グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLC	ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(円ヘッジ・クラス)	99.4%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.0%
合計		99.4%

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。
 ・2015年は設定日(9月8日)から年末、2017年は3月31日までの騰落率を表しています。

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

(参考情報) 運用実績

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

2017年3月31日現在
基準価額・純資産の推移

※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	9,303円
純資産総額	16億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.6%
3カ月間	-2.9%
6カ月間	8.3%
1年間	3.3%
3年間	-
5年間	-
設定来	-3.4%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 220円 設定来分配金合計額: 350円

決算期	第1期 16年3月	第2期 16年9月	第3期 17年3月							
分配金	130円	100円	120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。

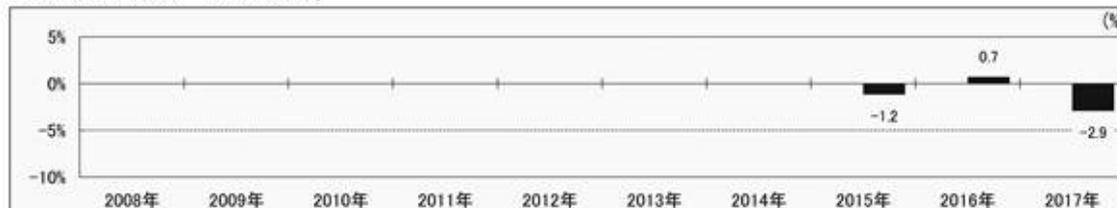
主要な資産の状況

※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
グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLC	ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(ノンヘッジ・クラス)	99.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・アセット・マザー・ファンド	0.0%
合計		99.5%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2015年は設定日(9月8日)から年末、2017年は3月31日までの騰落率を表しています。

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

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

(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3期計算期間（平成28年9月8日から平成29年3月7日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 財務諸表

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）】

1【財務諸表】

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	209,263,141	217,907,134
投資信託受益証券	5,808,661,944	8,711,803,486
親投資信託受益証券	1,000	1,000
流動資産合計	6,017,926,085	8,929,711,620
資産合計	6,017,926,085	8,929,711,620
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	69,170,747	80,208,865
未払解約金	55,901,850	18,399,425
未払受託者報酬	576,317	1,021,164
未払委託者報酬	25,360,404	44,932,893
その他未払費用	172,828	306,278
流動負債合計	151,182,146	144,868,625
負債合計	151,182,146	144,868,625
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,764,228,951	1 8,912,096,139
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 102,514,988	2 127,253,144
（分配準備積立金）	70,568,511	62,600,868
元本等合計	5,866,743,939	8,784,842,995
純資産合計	5,866,743,939	8,784,842,995
負債純資産合計	6,017,926,085	8,929,711,620

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	平成28年3月8日 至 平成28年9月7日	自	平成28年9月8日 至 平成29年3月7日
営業収益				
受取配当金		81,381,374		130,760,790
有価証券売買等損益		158,163,569		240,619,248
営業収益合計		239,544,943		109,858,458
営業費用				
支払利息		14,185		27,484
受託者報酬		576,317		1,021,164
委託者報酬		25,360,404		44,932,893
その他費用		173,250		306,278
営業費用合計		26,124,156		46,287,819
営業利益又は営業損失（ ）		213,420,787		156,146,277
経常利益又は経常損失（ ）		213,420,787		156,146,277
当期純利益又は当期純損失（ ）		213,420,787		156,146,277
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（ ）		5,378,282		19,898,956
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		78,384,973		102,514,988
剰余金増加額又は欠損金減少額		42,028,203		6,218,731
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,268,273		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		36,759,930		6,218,731
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		19,530,677
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		19,530,677
分配金		1 69,170,747		1 80,208,865
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		102,514,988		127,253,144

(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3期	
	自 平成28年9月8日	至 平成29年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	平成28年9月7日現在	平成29年3月7日現在
1. 1 期首元本額	3,578,552,480円	5,764,228,951円
期中追加設定元本額	2,489,519,247円	4,531,648,102円
期中一部解約元本額	303,842,776円	1,383,780,914円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,764,228,951口	8,912,096,139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127,253,144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2期 自 平成28年3月8日 至 平成28年9月7日	第3期 自 平成28年9月8日 至 平成29年3月7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(71,680,604円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(66,170,621円)、投資信託約款に規定される収益調整金(31,946,477円)及び分配準備積立金(1,888,033円)より分配対象額は171,685,735円(1万口当たり297.85円)であり、うち69,170,747円(1万口当たり120円)を分配金額としております。	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(84,179,838円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(73,976,901円)及び分配準備積立金(58,629,895円)より分配対象額は216,786,634円(1万口当たり243.25円)であり、うち80,208,865円(1万口当たり90円)を分配金額としております。

(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3期 自 平成28年9月8日 至 平成29年3月7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3期 平成29年3月7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2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7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	158,047,634	234,464,346
親投資信託受益証券	1	0
合計	158,047,633	234,464,346

（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2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7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3期 自 平成28年9月8日 至 平成29年3月7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2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0178円 (10,178円)	0.9857円 (9,857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	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	88,318,280.290	8,711,803,486	
投資信託受益証券 合計			8,711,803,486	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	999	1,000	
親投資信託受益証券 合計			1,000	
合計			8,711,804,486	

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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・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・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの計算期間末日（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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた（未監査の）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9月30日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \$99,055,775）	\$	100,994,846
現金		1,438
外国為替先渡契約の評価益		957,375
未収：		
受益証券の発行		1,982,573
売却済みの投資		1,088,615
利息		467,834
前払受託会社報酬		2,696
資産合計		105,495,377
負債		
外国為替先渡契約の評価損		49,475
未払：		
購入済みの投資		3,210,868
償還済み受益証券		365,378
投資運用会社報酬		79,650
専門家報酬		58,000
会計および管理会社報酬		24,704

保管会社報酬	24,469
販売報酬	10,485
管理報酬	7,212
為替取引執行会社報酬	4,533
代理人報酬	1,613
名義書換代理人報酬	253
その他負債	800
負債合計	3,837,440

純資産	\$ 101,657,937
------------	-----------------------

純資産

豪ドル・クラス	\$ 6,783,679
円ヘッジ・クラス	61,174,249
ノンヘッジ・クラス	17,628,299
NZドル・クラス	3,872,186
トルコ・リラ・クラス	2,524,097
米ドル・クラス	8,345,022
南アフリカ・ランド・クラス	1,330,405
	\$ 101,657,937

発行済み受益証券(口数)

豪ドル・クラス	85,590
円ヘッジ・クラス	60,923,653
ノンヘッジ・クラス	20,785,870
NZドル・クラス	51,372
トルコ・リラ・クラス	73,624
米ドル・クラス	80,324
南アフリカ・ランド・クラス	17,377

受益証券1口当り純資産額

豪ドル・クラス	\$ 79.26
円ヘッジ・クラス	\$ 1.004
ノンヘッジ・クラス	\$ 0.848
NZドル・クラス	\$ 75.38
トルコ・リラ・クラス	\$ 34.28
米ドル・クラス	\$ 103.89
南アフリカ・ランド・クラス	\$ 76.56

損益計算書

2015年9月9日(業務開始日)～2016年9月30日

投資収益

受取利息(源泉徴収税\$46,700控除後)	\$ 2,818,482
配当収益(源泉徴収税\$4,947控除後)	11,542
その他収益	2,355
投資収益合計	2,832,379

費用

投資運用会社報酬	357,693
設立費用	221,632
販売報酬	83,624
保管会社報酬	81,815
専門家報酬	75,757
会計および管理会社報酬	50,217

管理報酬	60,069
印刷費用	23,271
代理人報酬	16,428
支払利息	11,983
名義書換代理人報酬	11,643
受託会社報酬	11,331
為替取引執行会社報酬	10,894
登録費用	5,103
その他費用	2,699
費用合計	1,024,159
投資純利益	1,808,220
実現利益(損失)および評価益(損):	
実現利益(損失):	
証券投資	1,031,084
外国為替取引および外国為替先渡契約	5,526,500
純実現利益	6,557,584
評価益(損)の純変動:	
証券投資	1,939,071
外国為替換算および外国為替先渡契約	904,612
評価益の純変動	2,843,683
純実現・純評価益	9,401,267
運用による純資産の純増	\$ 11,209,487

投資明細表
2016年9月30日

	元本	銘柄名	評価額
		債券(90.9%)	
		オーストラリア(0.9%)	
		社債(0.9%)	
		BHP Billiton Finance USA, Ltd. (a),(b),(c)	
USD	250,000	6.75% due 10/19/75	\$ 283,125
		Newcrest Finance Pty, Ltd. (b)	
USD	100,000	4.20% due 10/01/22	104,181
USD	550,000	4.45% due 11/15/21	581,662
		社債合計	968,968
		オーストラリア合計(簿価 \$918,014)	968,968
		カナダ(0.9%)	
		社債(0.9%)	
		Husky Energy, Inc. (c)	
USD	200,000	4.00% due 04/15/24	208,740
		Yamana Gold, Inc. (c)	
USD	650,000	4.95% due 07/15/24	671,436
		社債合計	880,176
		カナダ合計(簿価 \$767,153)	880,176
		ケイマン諸島(26.8%)	
		資産担保証券(26.8%)	
		AIMCO CLO 2015-A Class BN (a),(b)	
USD	1,000,000	2.98% due 01/15/28	1,005,959
		Ares XXXV CLO, Ltd. 2015-35A Class C (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.53% due 10/15/25	992,166

		Benefit Street Partners CLO, Ltd. 2012-IA Class BR (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.78% due 10/15/25	996,458
		CIFC Funding 2012-I, Ltd. Class A2R (a),(b),(c)	
USD	960,000	2.92% due 08/14/24	960,580
		CIFC Funding 2014-III, Ltd. Class INC (a),(c)	
USD	500,000	0.00% due 07/22/26	313,323
		CIFC Funding 2015-III, Ltd. Class B (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	2.79% due 10/19/27	998,911
		Eagle I, Ltd. 2014-1A Class A2 (b)	
USD	501,875	4.31% due 12/15/39	489,705
		FDF I, Ltd. 2015-1A Class A (b)	
USD	1,000,000	4.40% due 11/12/30	1,050,758
		FDF II, Ltd. 2016-2A Class A (b)	
USD	1,000,000	4.29% due 05/12/31	1,018,462
		Fortress Credit BSL II, Ltd. 2013-2A Class A1F (a),(b)	
USD	1,000,000	2.19% due 10/19/25	1,002,248
		Galaxy XVIII CLO, Ltd. 2014-18A Class C1 (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.68% due 10/15/26	994,497
		Garrison Funding 2016-2, Ltd. Class A2 (a),(b)	
USD	1,000,000	4.01% due 09/29/27	997,300
		Gramercy Real Estate CDO 2006-1, Ltd. Class B (a),(b)	
USD	158,907	1.08% due 07/25/41	156,942
		Great Lakes CLO 2015-1, Ltd. Class A1 (a),(b)	
USD	2,000,000	2.63% due 07/15/26	1,984,915
		LCM XV LP 15A Class C (a),(b)	
USD	900,000	3.93% due 08/25/24	900,009
		LSTAR Securities Investment, Ltd. 2016-3 Class A (a),(b)	
USD	1,000,000	2.53% due 09/01/21	987,172
		LSTAR Securities Investment Trust 2015-4 Class A1 (a),(b)	
USD	1,909,517	2.49% due 04/01/20	1,885,648
		LSTAR Securities Investment Trust 2016-2 Class A (a),(b)	
USD	974,079	2.52% due 03/01/21	951,675
		Northwoods Capital XI, Ltd. 2014-11A Class C (a),(b)	
USD	1,000,000	3.43% due 04/15/25	978,126
		OCP CLO 2014-6, Ltd. Class D (a),(b),(c)	
USD	700,000	5.63% due 07/17/26	604,412
		OCP CLO 2016-11, Ltd. Class A2A (a),(b)	
USD	1,000,000	3.03% due 04/26/28	996,809
		Putnam Structured Product Funding 2003-1, Ltd. Class A2 (a),(b)	
USD	1,000,000	1.52% due 10/15/38	861,681
		Sound Point CLO III, Ltd. 2013-2A Class C1 (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.38% due 07/15/25	997,644
		SRERS-2011 Funding, Ltd. 2011-RS Class A1B2 (a),(b)	
USD	500,000	0.76% due 05/09/46	299,229
		TICP CLO III, Ltd. 2014-3A Class B1 (a),(b),(c)	
USD	500,000	3.05% due 01/20/27	500,040
		Venture XIII CLO, Ltd. 2013-13A Class SUB (b),(c)	
USD	500,000	0.00% due 06/10/25	277,008
		Venture XVI CLO, Ltd. 2014-16A Class A3L (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.43% due 04/15/26	993,000
		Voya CLO, Ltd. 2013-1A Class B (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.58% due 04/15/24	995,334
		Voya CLO, Ltd. 2014-2A Class B (a),(b),(c)	
USD	1,000,000	3.63% due 07/17/26	999,954
		WhiteHorse VIII, Ltd. 2014-1A Class B (a),(b)	
USD	1,100,000	2.81% due 05/01/26	1,079,548
		資産担保証券合計	27,269,513
		ケイマン諸島合計 (簿価 \$26,933,351)	27,269,513
		ドミニカ共和国 (0.4%)	
		国債 (0.4%)	
		Dominican Republic International Bond (b)	
USD	400,000	6.85% due 01/27/45	448,000

		国債合計	448,000
		ドミニカ共和国合計 (簿価 \$397,579)	448,000
		アイルランド (0.4%)	
		資産担保証券 (0.4%)	
		ECAF I, Ltd. 2015-1A Class B1 (b)	
USD	463,351	5.80% due 06/15/40	454,084
		資産担保証券合計	454,084
		アイルランド合計 (0.4%) (簿価 \$466,215)	454,084
		ケニア (0.5%)	
		国債 (0.5%)	
		Kenya Government International Bond (b)	
USD	500,000	6.88% due 06/24/24	490,000
		国債合計	490,000
		ケニア合計 (簿価 \$475,823)	490,000
		ルクセンブルク (0.7%)	
		バンクローン (0.7%)	
		Altice France S.A.	
USD	199,500	5.00% due 01/15/24	201,894
		Travelport Finance (Luxembourg) S.a.r.l.	
USD	488,665	5.00% due 09/02/21	491,414
		バンクローン合計	693,308
		ルクセンブルク合計 (簿価 \$686,959)	693,308
		ペルー (0.4%)	
		国債 (0.4%)	
		Corp. Financiera de Desarrollo S.A. (a),(b),(c)	
USD	350,000	5.25% due 07/15/29	377,125
		国債合計	377,125
		ペルー合計 (簿価 \$346,707)	377,125
		米国 (59.9%)	
		資産担保証券 (28.7%)	
		Apollo Aviation Securitization Equity Trust 2016 – 1 Class A (b)	
USD	475,000	4.88% due 03/17/36	469,063
		Banc of America Funding 2015-R4 Trust Class 8A1 (a),(b)	
USD	1,003,244	0.70% due 01/27/35	935,423
		Capmark Military Housing Trust 2007-AET2 Class A (b)	
USD	487,525	6.06% due 10/10/52	491,884
		Castle Aircraft SecuritizationTrust 2015-1 Class A (b)	
USD	914,676	4.70% due 12/15/40	905,529
		CD 2016-CD1 Mortgage Trust Class XA (a)	
USD	999,471	1.58% due 08/10/49	105,271
		Cent CDO 14, Ltd. 2007-14A Class C (a),(b)	
USD	1,000,000	1.38% due 04/15/21	928,618
		Cerberus Onshore II CLO LLC 2013-1A Class C (a),(b)	
USD	250,000	4.18% due 10/15/23	248,852
		Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 Class XA (a)	
USD	999,545	1.95% due 08/10/49	133,245
		Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC36 Class C (a)	
USD	1,100,000	4.92% due 02/10/49	1,177,324
		Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 Class XA (a)	
USD	3,841,117	1.97% due 04/10/49	495,901
		Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 Class C (a)	
USD	750,000	4.47% due 10/10/49	751,447
		COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust Class XA (a)	
USD	6,661,928	1.21% due 10/10/48	452,965
		CSMC Series 2015-12R Class 2A1 (a),(b)	
USD	1,150,000	0.99% due 11/30/37	1,080,707
		Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust Series	
		2006-OA1 Class A1 (a),(c)	
USD	1,109,846	0.73% due 02/25/47	904,442
		Fortress Credit Opportunities III CLO LP 2014-3A Class A1T (a),(b)	
USD	1,000,000	2.56% due 04/28/26	997,800

USD	1,000,000	FREMF 2015-K46 Mortgage Trust Class B (a),(b) 3.82% due 04/25/48	992,897
USD	500,000	GS Mortgage Securities Corp. Trust 2016-ICE2 Class C (a),(b) 4.77% due 02/15/33	503,501
USD	1,000,000	GSA Trust 2005-6 Class M1 (a),(c) 0.96% due 06/25/35	899,841
USD	894,201	GSMSC Resecuritization Trust 2015-8R Class A (a),(b) 0.67% due 04/26/37	810,652
USD	978,500	Harbour Aircraft Investment, Ltd. 2016-1 Class A 4.70% due 07/15/41	981,693
USD	906,714	Hilton USA Trust 2013-HLF Class DFL (a),(b) 3.27% due 11/05/30	906,714
USD	469,836	Lehman XS Trust Series 2005-7N Class 1A1A (a),(c) 0.80% due 12/25/35	418,428
USD	1,238,709	0.71% due 02/25/37	855,374
USD	1,397,516	LSTAR Securities Investment Trust 2015-1 Class A (a),(b) 2.52% due 01/01/20	1,395,420
USD	942,904	LSTAR Securities Investment Trust 2015-2 Class A (a),(b) 2.52% due 01/01/20	929,832
USD	423,364	LSTAR Securities Investment Trust 2015-3 Class A (a),(b) 2.52% due 03/01/20	417,801
USD	2,500,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11 Class XA (a) 1.83% due 08/15/49	279,140
USD	1,000,000	Motel 6 Trust 2015-MTL Class D (b) 4.53% due 02/05/30	1,003,326
USD	664,441	Nationstar HECM Loan Trust 2016-1A Class A (b),(c) 2.98% due 02/25/26	663,956
USD	1,169,376	RALI Series 2006-QO10 Trust Class A1 (a),(c) 0.69% due 01/25/37	986,118
USD	2,243,488	RALI Series 2006-QO2 Trust Class A1 (a),(c) 0.75% due 02/25/46	987,314
USD	408,775	STORE Master Funding LLC 2013-2A Class A2 (b) 5.33% due 07/20/43	431,130
USD	600,000	Taco Bell Funding LLC 2016-1A Class A23 (b),(c) 4.97% due 05/25/46	621,380
USD	648,193	Venture VII CDO, Ltd. 2006-7A Class A1A (a),(b) 0.93% due 01/20/22	642,863
USD	744,401	VOLT XXXIX LLC 2015-NP13 Class A1 (b) 4.13% due 10/25/45	750,329
USD	685,640	VOLT XXXVI LLC 2015-NP10 Class A1 (b),(c) 3.63% due 07/25/45	686,728
USD	1,073,078	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust Class A (a),(b) 0.66% due 07/25/37	935,303
USD	1,293,264	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR9 Trust Class 1A (a),(c) 1.34% due 11/25/46	935,559
USD	4,976,057	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 Class XA (a) 1.74% due 01/15/59	489,769
USD	495,000	Wendys Funding LLC 2015-1 Class A23 (b) 4.50% due 06/15/45	494,265
		資産担保証券合計	29,097,804
		バンクローン (5.3%)	
USD	374,051	American Tire Distributors, Inc. 5.25% due 09/01/21	370,357
USD	349,125	Cengage Learning, Inc. 5.25% due 06/07/23	349,437
USD	500,000	Ceridian HCM Holding, Inc. 4.50% due 09/15/20	490,312
USD	400,000	Cvent, Inc. 5.00% due 06/16/23	403,500
USD	400,000	Dayton Power and Light Co. 4.00% due 08/24/22	405,252

USD	350,000	DJO Finance LLC 3.25% due 06/08/20	344,094
USD	292,579	Dole Food Co., Inc. 4.51% due 11/01/18	293,835
USD	272,236	EIG Investors Corp. 6.00% due 02/09/23	254,541
USD	339,394	Engility Corp. 5.75% due 08/14/23	343,212
USD	300,000	Epicor Software Corp. 4.00% due 06/01/22	297,563
USD	200,000	Leslie's Poolmart, Inc. 4.25% due 08/16/23	201,625
USD	444,083	P.F. Chang's China Bistro, Inc. 4.53% due 07/02/19	439,087
USD	450,000	Smart & Final Stores LLC 4.30% due 11/15/22	450,985
USD	248,750	Solera LLC 5.75% due 03/03/23	251,678
USD	507,249	SRS Distribution, Inc. 5.25% due 08/25/22	512,955
		バンクローン合計	5,408,433
		社債 (13.9%)	
USD	80,000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp. (c) 5.63% due 05/20/24	84,800
USD	600,000	Bank of America Corp. (a),(c),(d) 6.10% due 12/29/49	625,500
USD	100,000	6.30% due 12/29/49	108,625
USD	500,000	Bumble Bee Holdings, Inc. (b),(c) 9.00% due 12/15/17	502,500
USD	490,000	Citigroup, Inc. (a),(c),(d) 5.95% due 12/29/49	499,849
USD	200,000	6.25% due 12/29/49	215,250
USD	400,000	ConocoPhillips 6.50% due 02/01/39	516,331
USD	250,000	CSC Holdings LLC (b),(c) 6.63% due 10/15/25	271,250
USD	475,000	DISH DBS Corp. 5.88% due 11/15/24	469,063
USD	250,000	EQT Corp. 4.88% due 11/15/21	273,740
USD	300,000	Federal Home Loan Banks 5.50% due 07/15/36	434,845
USD	600,000	Federal Home Loan Mortgage Corp. 0.00% due 12/14/29	429,872
USD	89,000	6.75% due 03/15/31	137,528
USD	1,550,000	FNMA Principal Strip 0.00% due 05/15/30	1,093,452
USD	500,000	Fort Benning Family Communities LLC (b) 5.81% due 01/15/51	506,240
USD	1,800,000	Freddie Mac Strips 0.00% due 03/15/31	1,232,586
USD	200,000	GEO Group, Inc. (c) 5.88% due 10/15/24	172,000
USD	200,000	Gulfstream Natural Gas System LLC (b),(c) 4.60% due 09/15/25	209,703
USD	350,000	Halliburton Co. (c) 4.85% due 11/15/35	375,144
USD	200,000	Hess Corp. (c) 4.30% due 04/01/27	201,557
USD	550,000	Hospitality Properties Trust (c) 5.25% due 02/15/26	581,593
		HP Communities LLC (b)	

USD	500,000	5.78% due 03/15/46 Kennedy-Wilson, Inc. (c)	579,885
USD	300,000	5.88% due 04/01/24 Micron Technology, Inc. (b),(c)	302,250
USD	350,000	5.25% due 08/01/23 Molex Electronic Technologies LLC (b),(c)	345,625
USD	267,000	3.90% due 04/15/25 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp. (c)	272,563
USD	100,000	5.25% due 08/01/26 Sprint Communications, Inc. (b)	103,750
USD	450,000	7.00% due 03/01/20 Sunoco Logistics Partners Operations LP (c)	482,625
USD	600,000	5.95% due 12/01/25 Teachers Insurance & Annuity Association of America (a),(b),(c)	695,363
USD	500,000	4.38% due 09/15/54 Tennessee Valley Authority	506,250
USD	500,000	4.25% due 09/15/65	594,832
USD	250,000	5.38% due 04/01/56 Vector Group, Ltd. (c)	353,743
USD	400,000	7.75% due 02/15/21 WP Carey, Inc. (c)	421,880
USD	550,000	4.25% due 10/01/26	557,636
		社債合計	14,157,830
		国債 (10.5%)	
		Federal National Mortgage Association	
USD	700,000	1.88% due 09/24/26 FNMA Principal Strip	696,490
USD	600,000	0.00% due 05/15/29 Freddie Mac Strips	430,712
USD	250,000	0.00% due 09/15/29	178,815
USD	750,000	0.00% due 07/15/32 U.S. Treasury Note	486,224
USD	4,745,000	1.50% due 08/15/26 U.S. Treasury Strip Principal	4,698,845
USD	8,237,000	0.00% due 11/15/44	4,171,966
		国債合計	10,663,052
		地方債 (1.5%)	
		County of Miami-Dade FL Aviation Revenue (c)	
USD	700,000	3.86% due 10/01/41 State of California	706,377
USD	500,000	7.60% due 11/01/40	810,565
		地方債合計	1,516,942
		米国合計 (簿価 \$59,494,363)	60,844,061
		債券合計 (簿価 \$90,486,164)	92,425,235
		短期投資 (8.4%)	
		米国 (8.4%)	
		定期預金 (3.5%)	
		JPMorgan Chase & Co.	
USD	3,570,610	0.15% due 10/03/16	3,570,610
		定期預金合計	3,570,610
		国債 (1.1%)	
		Federal Home Loan Bank Discount Notes	
	1,100,000	0.21% due 10/19/16	1,099,884
		国債合計	1,099,884
		コマースャル・ペーパー (3.8%)	
		Campbell Soup Co.	
USD	1,500,000	0.55% due 10/06/16 Nissan Motor Acceptance Corp.	1,499,885
USD	1,400,000	0.68% due 10/17/16 Ryder System, Inc.	1,399,577
USD	1,000,000	0.73% due 10/18/16	999,655
		コマースャル・ペーパー合計	3,899,117

米国合計(簿価 \$8,569,611)		8,569,611
短期投資合計(簿価 \$8,569,611)		8,569,611
投資総額(簿価 \$99,055,775)	99.3	\$ 100,994,846
負債を超過する現金およびその他の資産	0.7	663,091
純資産	100.0%	\$ 101,657,937

(a) 2016年9月30日時点の変動金利証券。

(b) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家への転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は流動性がないとはみなされません。

(c) 期前償還条項付き証券。

(d) 永久債。

ファンドレベルの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.0%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
JPY	Citibank N.A.	10,000,000	2016年10月4日	USD	98,431	\$ 320	\$ -	\$ 320
JPY	Citibank N.A.	7,000,000	2016年10月5日	USD	69,158	-	(30)	(30)
JPY	Citibank N.A.	20,000,000	2016年10月5日	USD	197,595	-	(86)	(86)
USD	Citibank N.A.	242,709	2016年10月3日	TRY	723,782	1,504	-	1,504
USD	Citibank N.A.	169,353	2016年10月3日	NZD	232,131	547	-	547
USD	Citibank N.A.	38,930	2016年10月3日	ZAR	525,930	684	-	684
USD	Citibank N.A.	80,446	2016年10月4日	NZD	111,045	-	(305)	(305)
USD	Citibank N.A.	98,748	2016年10月4日	AUD	128,932	83	-	83
USD	Citibank N.A.	63,785	2016年10月4日	TRY	190,513	295	-	295
USD	Citibank N.A.	76,989	2016年10月5日	AUD	100,589	15	-	15
USD	Citibank N.A.	214,840	2016年10月5日	TRY	644,342	160	-	160
						\$ 3,608	\$ (421)	\$ 3,187

豪ドル・クラスの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.1%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
AUD	Citibank N.A.	8,876,018	2016年10月20日	USD	6,715,877	\$ 74,063	\$ -	\$ 74,063

円ヘッジ・クラスの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.8%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
JPY	Citibank N.A.	6,186,571,565	2016年10月20日	USD	60,308,332	\$ 824,832	\$ -	\$ 824,832

NZドル・クラスの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.0%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
NZD	Citibank N.A.	5,331,390	2016年10月20日	USD	3,906,270	\$ -	\$ (31,900)	\$ (31,900)

トルコ・リラ・クラスの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.0%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
TRY	Citibank N.A.	7,582,218	2016年10月20日	USD	2,535,212	\$ -	\$ (17,154)	\$ (17,154)

南アフリカ・ランド・クラスの外国為替先渡契約 2016年9月30日現在(純資産の0.1%)

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
ZAR	Citibank N.A.	18,277,299	2016年10月20日	USD	1,270,306	\$ 54,872	\$ -	\$ 54,872

通貨の略称

AUD	-	豪ドル
JPY	-	日本円
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・マネーアセット・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年9月7日現在	平成29年3月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,832,534,741	8,582,724,656
国債証券	5,720,240,602	1,970,040,920
未収利息	1,545,840	-
流動資産合計	10,554,321,183	10,552,765,576
資産合計	10,554,321,183	10,552,765,576
負債の部		
流動負債		
未払金	150,001,200	140,001,820
流動負債合計	150,001,200	140,001,820
負債合計	150,001,200	140,001,820
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,386,469,486	10,398,091,147
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,850,497	14,672,609
元本等合計	10,404,319,983	10,412,763,756
純資産合計	10,404,319,983	10,412,763,756
負債純資産合計	10,554,321,183	10,552,765,576

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9月8日 至 平成29年3月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年9月7日現在	平成29年3月7日現在
1. 1 期首	平成28年3月8日	平成28年9月8日
期首元本額	11,317,590,486円	10,386,469,486円
期中追加設定元本額	23,503,082円	1,699,095,019円
期中一部解約元本額	954,624,082円	1,687,473,358円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	999円	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）	999円	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）	999円	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株 クワトロプレミアム（毎月分配型）	219,583円	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株 クワトロプレミアム（年2回決算型）	24,953円	24,953円
ダイワ米国株主還元株ツインプレミアム（毎月分配型）	848,389円	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツインプレミアム（年2回決算型）	66,873円	66,873円
ダイワ米国株主還元株ファンド	36,730,213円	36,730,213円

ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	4,995円	4,995円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	4,995円	4,995円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-04(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-07(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-10(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2015-01(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 50 コース	49,911円	49,911円
ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 100 コース	49,911円	49,911円
ダイワ・オーストラリア高配 当株ファンド・マネー・ポー トフォリオ	39,458,478円	40,327,328円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver3 -	1,128,222,690円	1,078,302,562円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver7 -	- 円	1,188,092,062円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver5 -	2,095,808,384円	2,095,808,384円
ダイワ円債セレクト マネー コース	- 円	699,022円
ダイワ・スイス高配当株ツイ ン (毎月分配型)	2,996,106円	2,996,106円

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース	5,990,216円	5,990,216円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース	1,397,544円	1,397,544円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	3,994,008円	3,994,008円
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクト・コース	1,597,623円	1,597,623円
ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型)為替ヘッジあり	40,885円	40,885円
ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型)為替ヘッジなし	100,789円	100,789円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)	29,988,005円	22,499,238円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)	1,999,201円	1,999,201円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型)	1,002,195円	502,943円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース(毎月分配型)	3,011,774円	1,014,769円
ダイワ新興国ハイインカム・プラス - インカムチェンジ(積立型) -	1,527,685円	1,527,685円
ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト11 -	3,536,610,361円	3,536,610,361円
ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト12 -	2,207,003,670円	1,088,870,549円

ダイワ日本株式インデック ス・ファンド（限定追加型） - シフト13 -	1,287,713,056円	1,287,713,056円
計	10,386,469,486円	10,398,091,147円
2. 期末日における受益権の総数	10,386,469,486口	10,398,091,147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9月8日 至 平成29年3月7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3月7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	平成28年9月7日現在	平成29年3月7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	2,710,838	65,990
合計	2,710,838	65,990

（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9月7日まで、及び平成28年12月10日から平成29年3月7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9月7日現在	平成29年3月7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9月7日現在	平成29年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.0017円	1.0014円
（1万口当たり純資産額）	（10,017円）	（10,014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 3 1 国庫短期証券	390,000,000	390,003,174	
	6 4 9 国庫短期証券	1,010,000,000	1,010,015,978	
	6 5 1 国庫短期証券	570,000,000	570,021,768	
国債証券 合計			1,970,040,920	
合計			1,970,040,920	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

(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3期計算期間（平成28年9月8日から平成29年3月7日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 財務諸表

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）】

1【財務諸表】

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,301,224	53,217,967
投資信託受益証券	1,912,224,675	1,588,683,734
親投資信託受益証券	1,000	1,000
流動資産合計	1,975,526,899	1,641,902,701
資産合計	1,975,526,899	1,641,902,701
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,172,617	20,155,253
未払解約金	4,044,150	21,677,664
未払受託者報酬	261,409	231,227
未払委託者報酬	11,503,968	10,176,038
その他未払費用	78,346	69,298
流動負債合計	38,060,490	52,309,480
負債合計	38,060,490	52,309,480
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,217,261,723	1 1,679,604,468
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 279,795,314	2 90,011,247
（分配準備積立金）	6,961,465	5,329,908
元本等合計	1,937,466,409	1,589,593,221
純資産合計	1,937,466,409	1,589,593,221
負債純資産合計	1,975,526,899	1,641,902,701

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	平成28年3月8日 至 平成28年9月7日	自	平成28年9月8日 至 平成29年3月7日
営業収益				
受取配当金		35,617,470		23,992,192
有価証券売買等損益		111,485,362		157,466,867
営業収益合計		75,867,892		181,459,059
営業費用				
支払利息		4,680		8,681
受託者報酬		261,409		231,227
委託者報酬		11,503,968		10,176,038
その他費用		78,532		69,298
営業費用合計		11,848,589		10,485,244
営業利益又は営業損失()		87,716,481		170,973,815
経常利益又は経常損失()		87,716,481		170,973,815
当期純利益又は当期純損失()		87,716,481		170,973,815
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()		6,231,172		52,913,951
期首剰余金又は期首欠損金()		157,199,157		279,795,314
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,311,487		131,169,378
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,311,487		131,169,378
剰余金減少額又は欠損金増加額		34,249,718		39,289,922
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		34,249,718		39,289,922
分配金		1 22,172,617		1 20,155,253
期末剰余金又は期末欠損金()		279,795,314		90,011,247

(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3期	
	自 平成28年9月8日	至 平成29年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	平成28年9月7日現在	平成29年3月7日現在
1. 1 期首元本額	2,097,179,018円	2,217,261,723円
期中追加設定元本額	321,078,931円	524,592,394円
期中一部解約元本額	200,996,226円	1,062,249,649円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,217,261,723口	1,679,604,468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279,795,314円でありませす。	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90,011,247円でありませす。
------------	--	---

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第2期	第3期
	自 平成28年3月8日 至 平成28年9月7日	自 平成28年9月8日 至 平成29年3月7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（23,674,172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（1,445,116円）及び分配準備積立金（5,459,910円）より分配対象額は30,579,198円（1万口当たり137.91円）であり、うち22,172,617円（1万口当たり100円）を分配金額としております。	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（21,516,290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（3,983,212円）及び分配準備積立金（3,968,871円）より分配対象額は29,468,373円（1万口当たり175.45円）であり、うち20,155,253円（1万口当たり120円）を分配金額としております。

（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3期
	自 平成28年9月8日 至 平成29年3月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 平成29年3月7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2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7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	105,897,217	110,634,833
親投資信託受益証券	1	0
合計	105,897,218	110,634,833

（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2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7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）

<p>第3期</p> <p>自 平成28年9月8日</p> <p>至 平成29年3月7日</p>
<p>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。</p>

（1口当たり情報）

	第2期 平成28年9月7日現在	第3期 平成29年3月7日現在
1口当たり純資産額	0.8738円	0.9464円
（1万口当たり純資産額）	(8,738円)	(9,464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	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	16,859,101.740	1,588,683,734	
投資信託受益証券 合計			1,588,683,734	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	999	1,000	
親投資信託受益証券 合計			1,000	
合計			1,588,684,734	

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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(ノンヘッジ・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・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの計算期間末日(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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(ノンヘッジ・クラス)」の状況

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

【純資産額計算書】

平成29年3月31日

資産総額	8,652,395,280円
負債総額	28,084,834円
純資産総額（ - ）	8,624,310,446円
発行済数量	8,720,745,928口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9889円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

純資産額計算書

平成29年3月31日

資産総額	10,342,249,387円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	10,342,249,387円
発行済数量	10,328,118,887口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0014円

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

平成29年3月31日

資産総額	1,662,208,022円
負債総額	5,014,159円
純資産総額（ - ）	1,657,193,863円
発行済数量	1,781,390,845口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9303円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）」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3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年3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	73	221,350
追加型株式投資信託	686	13,318,905
株式投資信託 合計	759	13,540,255
単位型公社債投資信託	16	107,809
追加型公社債投資信託	14	2,036,709
公社債投資信託 合計	30	2,144,518
総合計	789	15,684,773

3 【委託会社等の経理状況】

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

<訂正後>

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	243
建物	21	18

器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2 4,127	2 4,390
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
固定負債		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435

純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14

その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-

その他	26	-
特別損失計	772	-
税引前当期純利益	19,651	19,471
法人税、住民税及び事業税	6,238	6,215
法人税等調整額	17	6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

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「投資有価証券売却益」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372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金	4,084百万円	4,320百万円

3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（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。

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	-

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,428百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,148円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月24日

当事業年度(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

(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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（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。

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(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	996	1,049

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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（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

（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27年3月31日）

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

当事業年度（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。

2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,025百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	32	-	1
(2) その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

当事業年度(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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、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。

(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いません。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	118	120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

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

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

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170百万円、当事業年度172百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引(譲渡損)	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	613	347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.02%	0.02%
評価性引当額の増減額	2.67%	1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.51%	0.19%
その他	0.07%	0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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。

[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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（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。

（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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (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)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成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。

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26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,153
有価証券	529
未収委託者報酬	9,521
繰延税金資産	428
その他	351
流動資産合計	32,984
固定資産	
有形固定資産	1 241
無形固定資産	
ソフトウェア	2,212
その他	252
無形固定資産合計	2,465
投資その他の資産	
投資有価証券	7,003
関係会社株式	5,129
その他	1,296
投資その他の資産合計	13,430
固定資産合計	16,137
資産合計	49,121

(単位:百万円)

当中間会計期間 (平成28年9月30日)	
負債の部	
流動負債	
未払金	7,144
未払費用	3,762
未払法人税等	1,205
賞与引当金	733
その他	3 434
流動負債合計	13,279
固定負債	
退職給付引当金	2,301
役員退職慰労引当金	122
その他	9
固定負債合計	2,432
負債合計	15,712
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,184
利益剰余金合計	6,559
株主資本合計	33,229
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	179
評価・換算差額等合計	179
純資産合計	33,408
負債・純資産合計	49,121

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
--	--

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	2	165
営業外費用	3	59
経常利益		8,290
特別利益		-
特別損失	4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		1,393
中間純利益		5,486

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（２）無形固定資産

定額法によっております。

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

１ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

3 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
MMF等償還関連費用	260百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成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

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,153	22,153	-
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	-
資産合計	38,186	38,186	-
(1) 未払金	7,144	7,144	-
(2) 未払費用(*)	3,762	3,762	-
負債合計	10,906	10,906	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,406	2,569	163
小計	2,406	2,569	163
合計	6,511	6,252	259

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

	当中間会計期間 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日)
1 株当たり純資産額	12,807.54円
1 株当たり中間純利益金額	2,103.26円

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

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

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4月7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債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）の平成28年9月8日から平成29年3月7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、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）の平成29年3月7日現在の信託財産の動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4月7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債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）の平成28年9月8日から平成29年3月7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、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）の平成29年3月7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28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、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28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月24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期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了す

る中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注)2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。