【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年8月14日提出
【計算期間】	第10特定期間 （自　2019年11月22日　至　2020年5月21日）
【ファンド名】	通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース 通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース 通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【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】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【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】

当ファンドは、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式　一般））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注1）商品分類の定義
- 「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- 「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- 「株式」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義
- 「その他資産」…組入れている資産
- 「株式　一般」…大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- 「年12回（毎月）」…目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの

・「ファンド・オブ・ファンズ」…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （株式　一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （含む日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり （　　） なし

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス http://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

◆安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式に投資します。

◆個別株または保有株の市場を代表する株価指数のコール・オプションを売却することで、カバードコール戦略を構築します。

◆株式およびオプション取引の運用は、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループが行ないます。

2 為替取引を活用します。

◆当ファンドには次の3つのコースがあり、原資産通貨売り／取引対象通貨買いの為替取引を行ないます。

※原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。

米ドル・コース

ブラジル・レアル・コース

通貨セレクト・コース

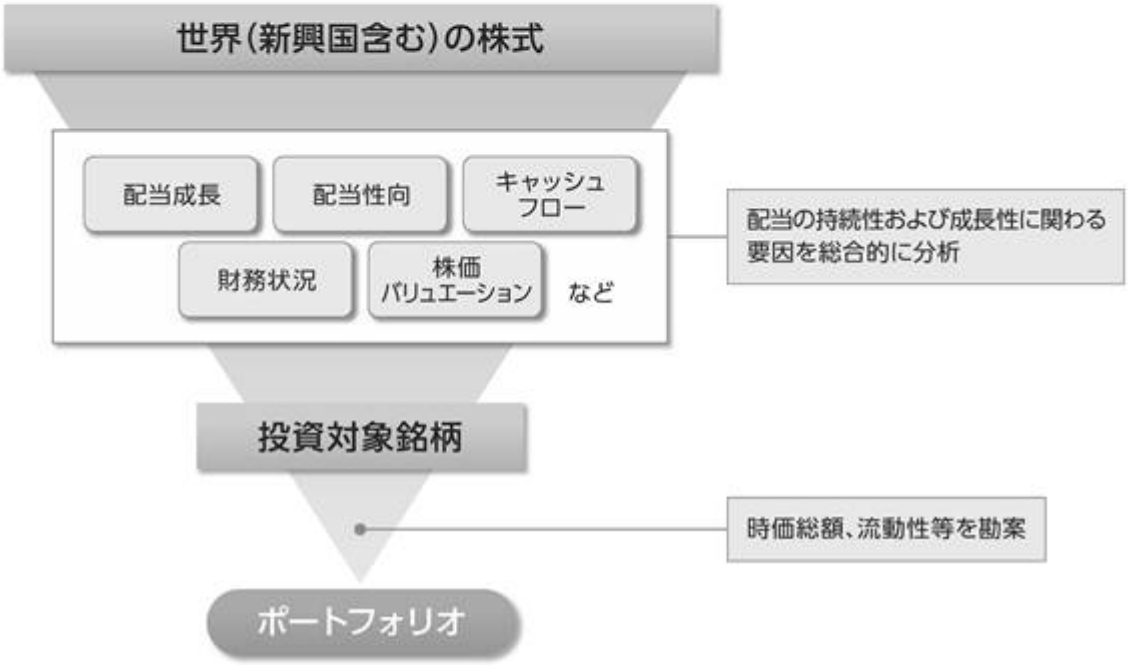
3 毎月21日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

1 安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

株式の運用にあたっては、以下の点に留意します。

- ◆ 世界の株式の中から、配当成長、配当性向、キャッシュフロー、財務状況、株価バリュエーション等を分析し、投資対象銘柄を選定します。
- ◆ 投資対象銘柄の中から、時価総額、流動性等を勘案し、ポートフォリオを構築します。

銘柄選定のイメージ



カバードコール戦略の構築にあたっては、以下の点に留意します。

◆ 個別株または保有株の市場を代表する株価指数のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの確保をめざします。
※「オプションプレミアム」とは、オプションの買い手が売り手に支払う対価をいいます。

◆ 株価の方向性やオプションの取引価格等を勘案し、個別銘柄ごとに評価額の全部または一部にかかるコール・オプションを売却することを基本とします。

カバードコール戦略とは

■ 株式を保有しつつ、株式のコール・オプション（買う権利）を売却する戦略です。

■ 株価の上昇／下落にかかわらず、オプションプレミアムを獲得することができます。

■ 一方で、株価の上昇による利益は一定の水準までに限定されます。

■ 株価が下落した場合、損失が発生しますが、オプションプレミアムにより値下がり損が軽減されることで、収益の改善が期待できます。

株式およびカバードコール戦略の運用は、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループが行ないます。

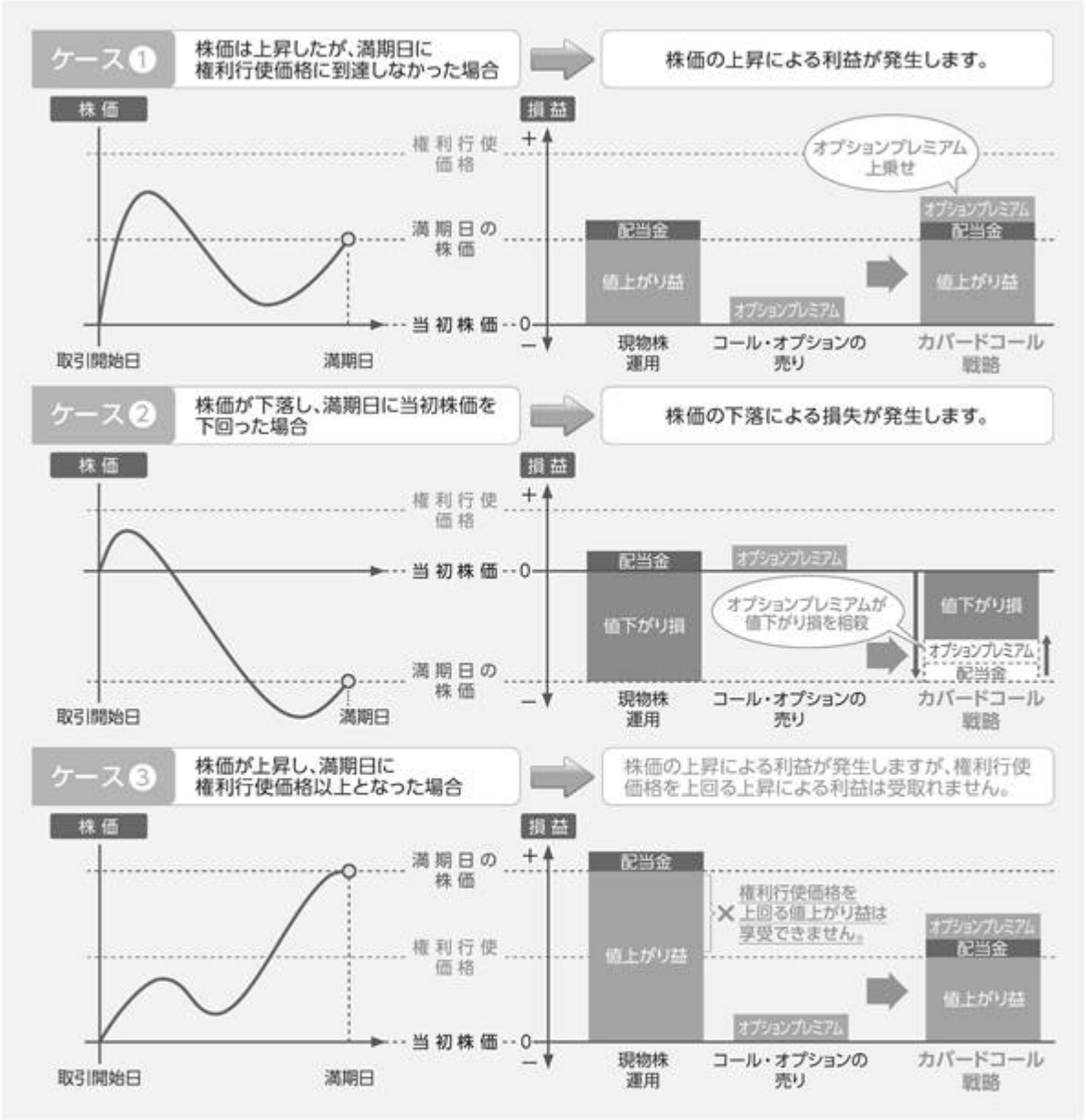
ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループについて

● ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループは1997年に設立された韓国の資産運用グループです。

● 韓国の最大手運用会社の一つであり、全世界で140,563百万米ドル（約14.2兆円）の資産残高を有します。（2020年5月末現在）

● 「ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（本社：韓国ソウル）」の他に、全世界の9拠点*（米国・ブラジル・カナダ・中国・香港・インド・オーストラリア・ベトナム・コロンビア）で運用・調査を行なっています。（2020年5月末現在）
*同グループは運用・調査を行なう9拠点の他に、英国に販売拠点を持っています。

カバードコール戦略における損益イメージ



※上記はイメージであり、実際の株価、配当金、オプションプレミアムとは異なります。また、投資成果を示唆または保証するものではありません。
※上記は個別銘柄ごとに、保有口数(株数)全部にかかるコール・オプションを売却した場合の、1つの権利行使期間における損益を表したものであり、当ファンド全体の損益を示したものではありません。
※当ファンドでは、満期日が到来する前に権利行使できるオプションを利用することがあります。
※「権利行使価格」とは、オプションの権利行使の基準となる株価をいいます。
※上記は配当金の支払いがあったことを前提として損益を表したものです。
※当ファンドにおいて、カバードコール戦略の損益は毎営業日時価評価され、基準価額に反映されます。

2 為替取引を活用します。

◆当ファンドには次の3つのコースがあり、原資産通貨売り／取引対象通貨買いの為替取引を行ないます。
※原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。

コース名	為替取引の内容	取引対象通貨
米ドル・コース	原資産通貨売り／米ドル買い	米ドル
ブラジル・レアル・コース	原資産通貨売り／ブラジル・レアル買い	ブラジル・レアル
通貨セレクト・コース	原資産通貨売り／選定通貨買い	選定通貨

◆各コースでは、保有資産について為替取引を行ないます。
これにより、「為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。

◆各コースでは、為替取引の対象通貨の対円レートの上昇（円安）／下落（円高）により、為替差益／為替差損が生じます。

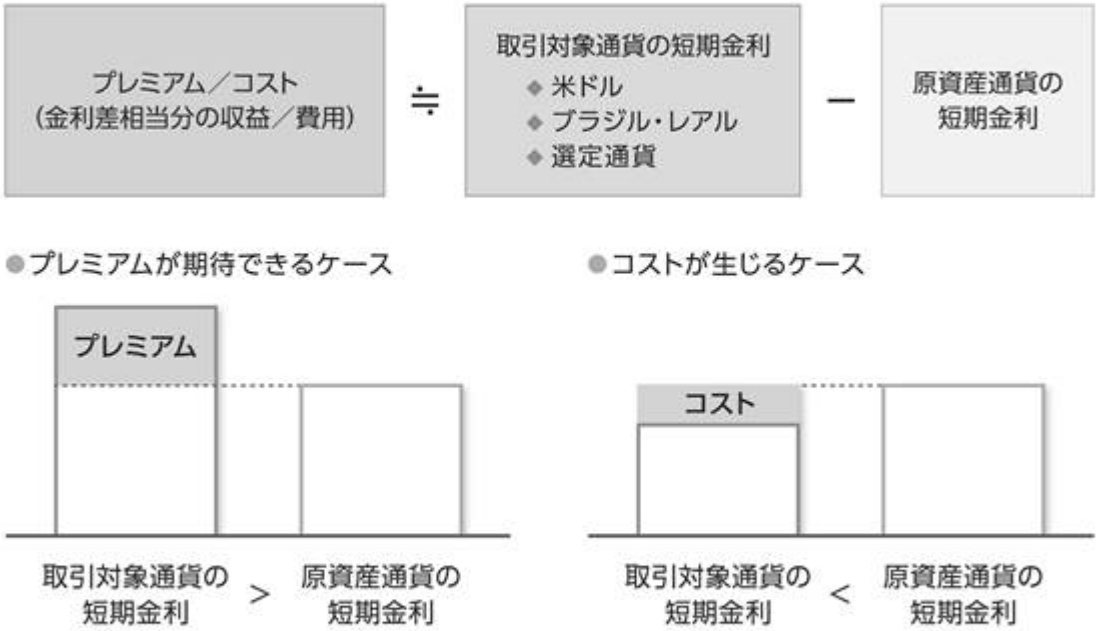
◆「通貨セレクト・コース」において、選定通貨とは、以下の［通貨の運用方針］により、為替取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。
※ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループは、大和アセットマネジメント株式会社の助言に基づき、通貨の選定および配分比率を決定します。

［通貨の運用方針］
- 原則として、「FTSE世界国債インデックス」および「JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ ブロード」の構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。
  ※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。
- 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。
- 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。

為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）について

■ 為替取引の対象通貨の短期金利が、原資産通貨の短期金利よりも高い場合、「プレミアム（金利差相当分の収益）」が期待できます。

■ 為替取引の対象通貨の短期金利が、原資産通貨の短期金利よりも低い場合、「コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。



※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。

※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

※実際の為替取引によるプレミアム／コストの水準は、需給要因等によって金利差相当分とは異なる水準となり、プレミアムの縮小、コストの拡大が生じることがあります。

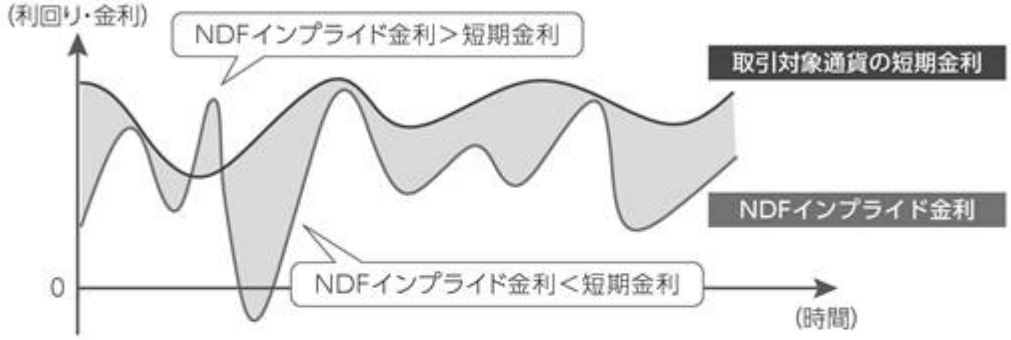
※取引対象通貨が新興国通貨の場合、為替取引を行なう際にNDF（ノン・デリバラブル・フォワード）取引を利用することがあります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際、プレミアム／コストは、需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

NDF取引とは

■ 取引対象通貨を用いた受け渡しは行なわず、米ドル等の主要通貨による差金決済を相対で行なう取引です。

■ NDF取引価格から算出される“NDFインプライド金利”は、市場の流動性が低く、割高や割安を是正する動き(裁定)が働きにくいことから、市場参加者の期待や需給などの要因により、短期金利の水準から大きく乖離する場合があります。

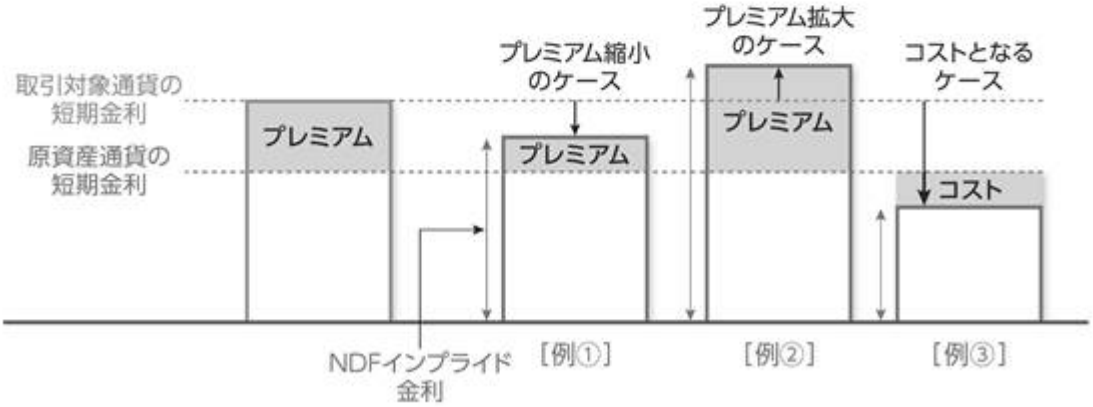
NDFインプライド金利と短期金利が乖離するイメージ



※上記はイメージであり、当ファンドのパフォーマンスとは異なります。

NDFインプライド金利の変動の影響

■ 市場参加者の通貨上昇(下落)期待や需給などにより、NDFインプライド金利は低く(高く)なる可能性があります。NDFインプライド金利が取引対象通貨の短期金利より低く(高く)なると、為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)が縮小[例①](拡大[例②])し、場合によっては為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)となるケース[例③]もあります。



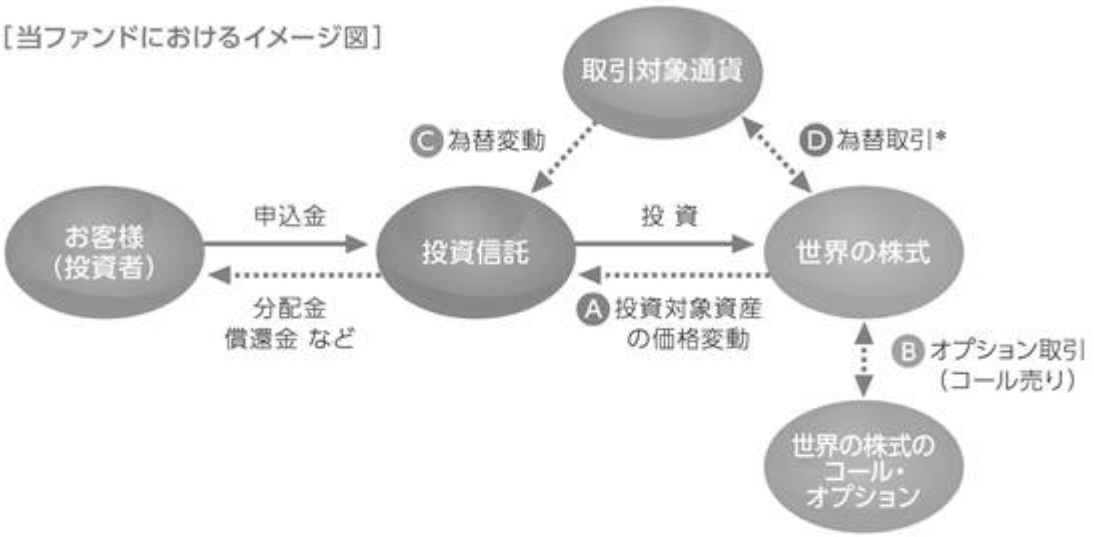
※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。
※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

通貨選択型ファンドの収益のイメージ

■ 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

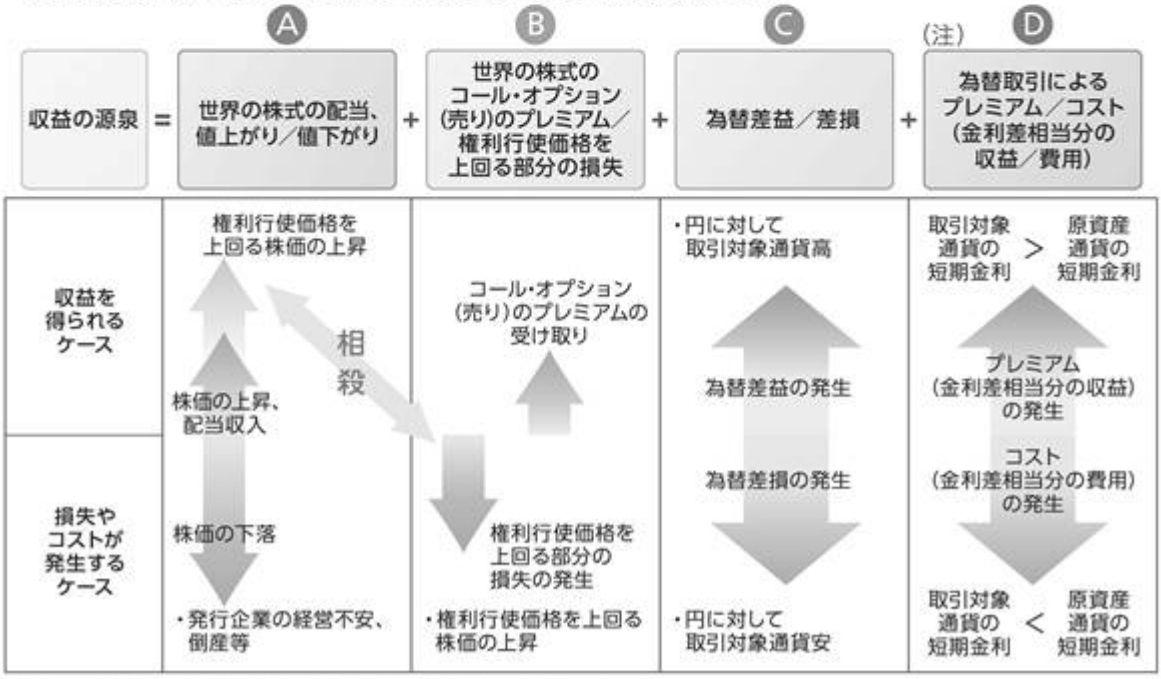
■ 当ファンドでは、世界の株式に投資するとともに、オプション取引および為替取引を活用します。

［当ファンドにおけるイメージ図］



*取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

■ 当ファンドの収益源としては、以下の4つの要素が挙げられます。
これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

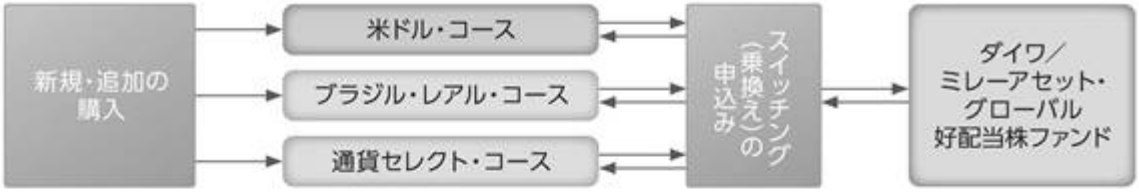


(注)為替取引を行なう際にNDF取引を利用することがあります。
NDF取引を用いて為替取引を行なう際、為替取引によるプレミアム／コスト(金利差相当分の収益／費用)は、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※上記はイメージであり、実際の投資成果を示唆、保証するものではありません。

スイッチング（乗換え）について

■ 各コース間、および「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」との間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。

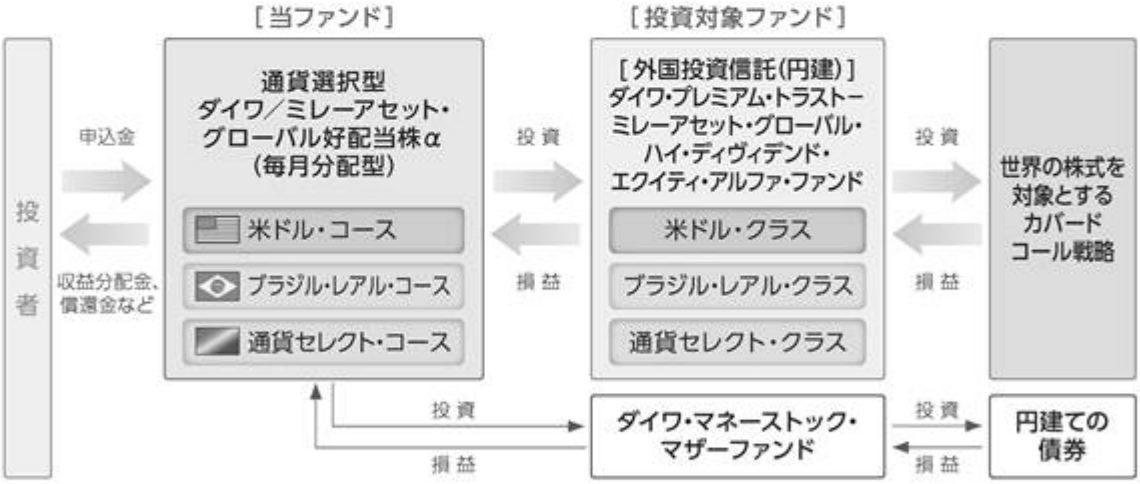


※「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」の申込みにつきましては、当該ファンドの交付目論見書をご参照下さい。

ファンドの仕組み

■ 当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

■ 外国投資信託の受益証券を通じて、世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。



※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

◆ 当ファンドは、通常の状態で、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

3 毎月21日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

［分配方針］

1. 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
2. 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ

※上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
※分配金額は、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。
※ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

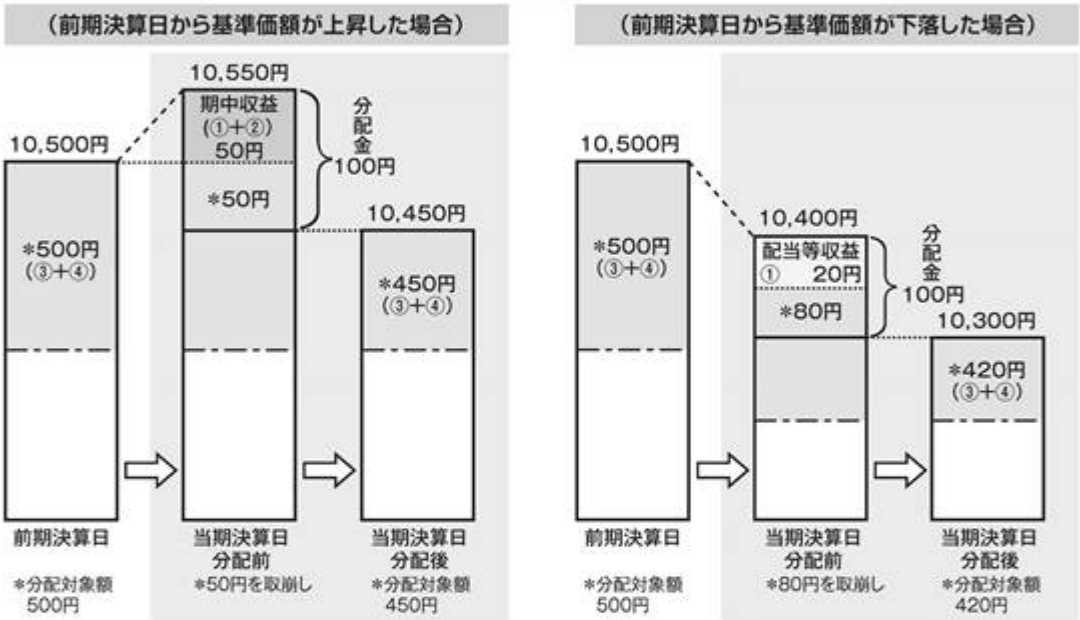
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

［収益分配金に関する留意事項］

●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

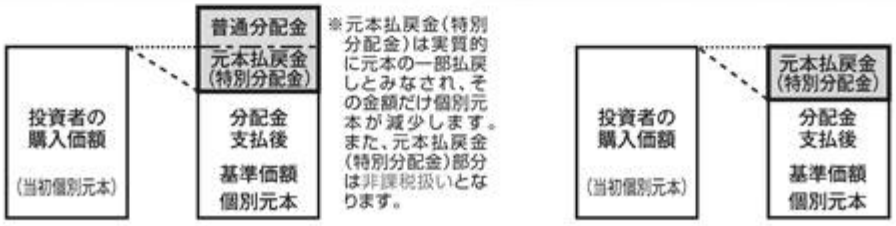


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）　（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金） … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご参照下さい。

＜投資対象ファンドの概要＞

①「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）」

②「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」

③「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）」

形態／表示通貨	**ケイマン籍の外国投資信託／円建**
運用の基本方針	**主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。**
主要投資対象	**世界の株式およびオプション**

運用方針	1. 主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。 2. 株式の運用にあたっては、以下の点に留意します。 ・世界の株式の中から、配当成長、配当性向、キャッシュフロー、財務状況、株価バリュエーション等を分析し、投資対象銘柄を選定します。 ・投資対象銘柄の中から、時価総額、流動性等を勘案し、ポートフォリオを構築します。 3. カバードコール戦略の構築にあたっては、以下の点に留意します。 ・個別株または保有株の市場を代表する株価指数のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの確保をめざします。 ・株価の方向性やオプションの取引価格等を勘案し、個別銘柄ごとに評価額の全部または一部にかかるコール・オプションを売却することを基本とします。 4. 「米ドル・クラス」 原則として、原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を活用して、米ドルへの投資成果の獲得をめざします。 ※原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。 「ブラジル・レアル・クラス」 原則として、原資産通貨売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を活用して、ブラジル・レアルへの投資成果の獲得をめざします。 ※原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。 「通貨セレクト・クラス」 原則として、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨への投資成果の獲得をめざします。 ※原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。 ※選定通貨とは、投資顧問会社が決定した複数の通貨をいいます。 ・投資顧問会社は、大和アセットマネジメント株式会社の助言に基づき、通貨の選定および配分比率を決定します。 <通貨の運用方針> ・原則として、FTSE世界国債インデックスおよびＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ ブロードの構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。 ※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。 ・選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。 ・選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。 5. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	2015年5月22日
信託期間	無期限

決算日	10月の最終営業日
収益分配	原則として、毎月分配を行ないます。
管理報酬等	「米ドル・クラス」「ブラジル・レアル・クラス」 純資産総額に対して年率0.70%程度 「通貨セレクト・クラス」 純資産総額に対して年率0.85%程度 ただし、この他に「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額13,500米ドルがかかります。また、監査費用、弁護士費用、有価証券売買委託手数料等、投資対象ファンドの運営に必要な各種経費がかかります。
申込手数料	かかりません。
投資顧問会社	ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシー
副投資顧問会社	ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ
通貨運用助言会社	大和アセットマネジメント株式会社

④ダイワ・マネーストック・マザーファンド

形態／表示通貨	国内籍の証券投資信託／円建
運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
投資態度	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 ③当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	2010年3月5日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

(2) 【ファンドの沿革】

2015年5月22日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2019年8月15日	信託期間終了日を2025年5月21日に変更（当初は2020年5月21日）

(3) 【ファンドの仕組み】

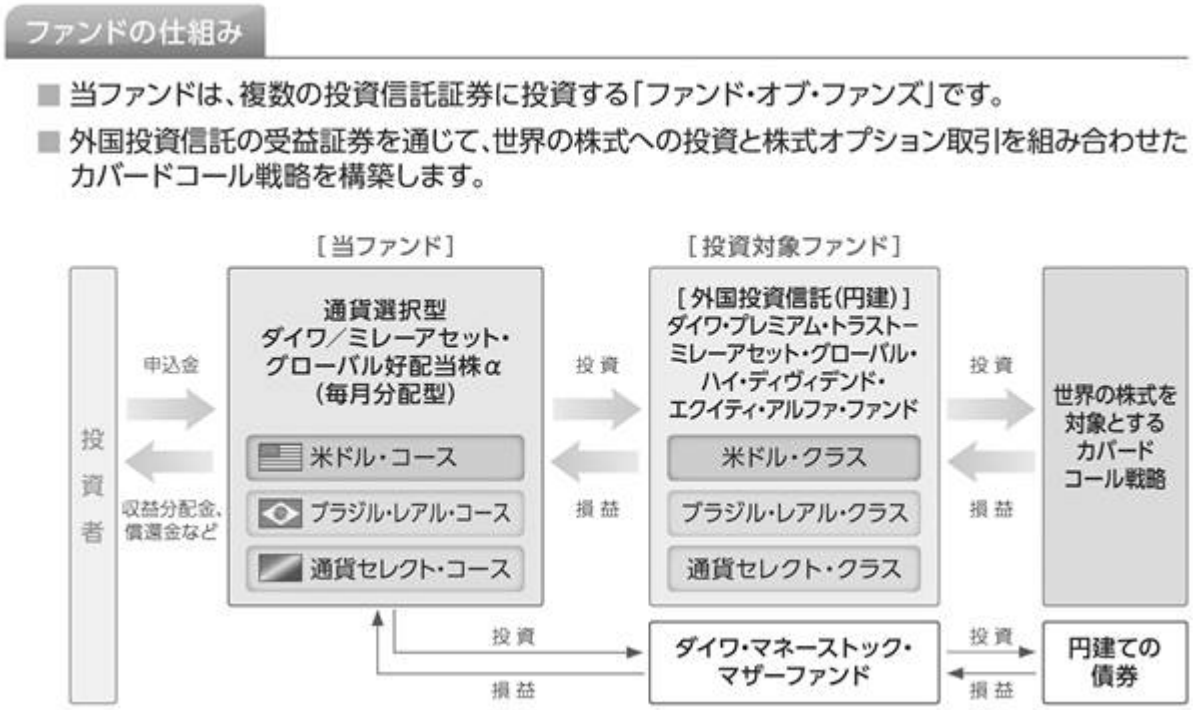
受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など
↓運用指図　↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	株式会社 りそな銀行 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など
	損益↑↓投資	
投資対象	投資対象ファンドの受益証券　など	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。



＜委託会社等の概況（2020年5月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

＜米ドル・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）」（以下「エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）の受益証券を通じて、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）では、「原資産通貨売り／米ドル買い」の為替取引を活用して、米ドルへの投資成果の獲得をめざします。

※　原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜ブラジル・レアル・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」（以下「エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）の受益証券を通じて、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、エクイ

ティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）では、「原資産通貨売り／ブラジル・レアル買い」の為替取引を活用して、ブラジル・レアルへの投資成果の獲得をめざします。

※　原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜通貨セレクト・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）」（以下「エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）の受益証券を通じて、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）では、「原資産通貨売り／選定通貨買い」の為替取引を活用して、選定通貨への投資成果の獲得をめざします。

※　原資産通貨とは、保有資産の表示通貨をいいます。

※　当ファンドにおいて、選定通貨とは、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した複数の通貨をいいます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜投資先ファンドについて＞

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

1. 米ドル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）

選定の方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

2. ブラジル・レアル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
選定の方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

3. 通貨セレクト・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）
選定の方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

くわしくは「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

(2) 【投資対象】

＜米ドル・コース＞

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受

益証券、ならびに次の3．から5．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2．ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）」の受益証券（円建）
3．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3．の証券の性質を有するもの
5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1．に掲げる投資信託の受益証券および前2．に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金
2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3．コール・ローン
4．手形割引市場において売買される手形

④　前②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

＜ブラジル・レアル・コース＞

①　（米ドル・コースと同規定）

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1．に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2．に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3．から5．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2．ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」の受益証券（円建）
3．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3．の証券の性質を有するもの
5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1．に掲げる投資信託の受益証券および前2．に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　（米ドル・コースと同規定）

④　（米ドル・コースと同規定）

＜通貨セレクト・コース＞

①　（米ドル・コースと同規定）

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1．に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2．に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3．から5．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2．ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券（円建）
3．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3．の証券の性質を有するもの
5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1．に掲げる投資信託の受益証券および前2．に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　（米ドル・コースと同規定）

④　（米ドル・コースと同規定）

＜投資先ファンドについて＞

ファンドの純資産総額の10％を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

1．米ドル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）
運用の基本方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。
主要な投資対象	世界の株式およびオプション
委託会社等の名称	投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシー 副投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ

2．ブラジル・レアル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
運用の基本方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。
主要な投資対象	世界の株式およびオプション
委託会社等の名称	投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシー 副投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ

3. 通貨セレクト・コース

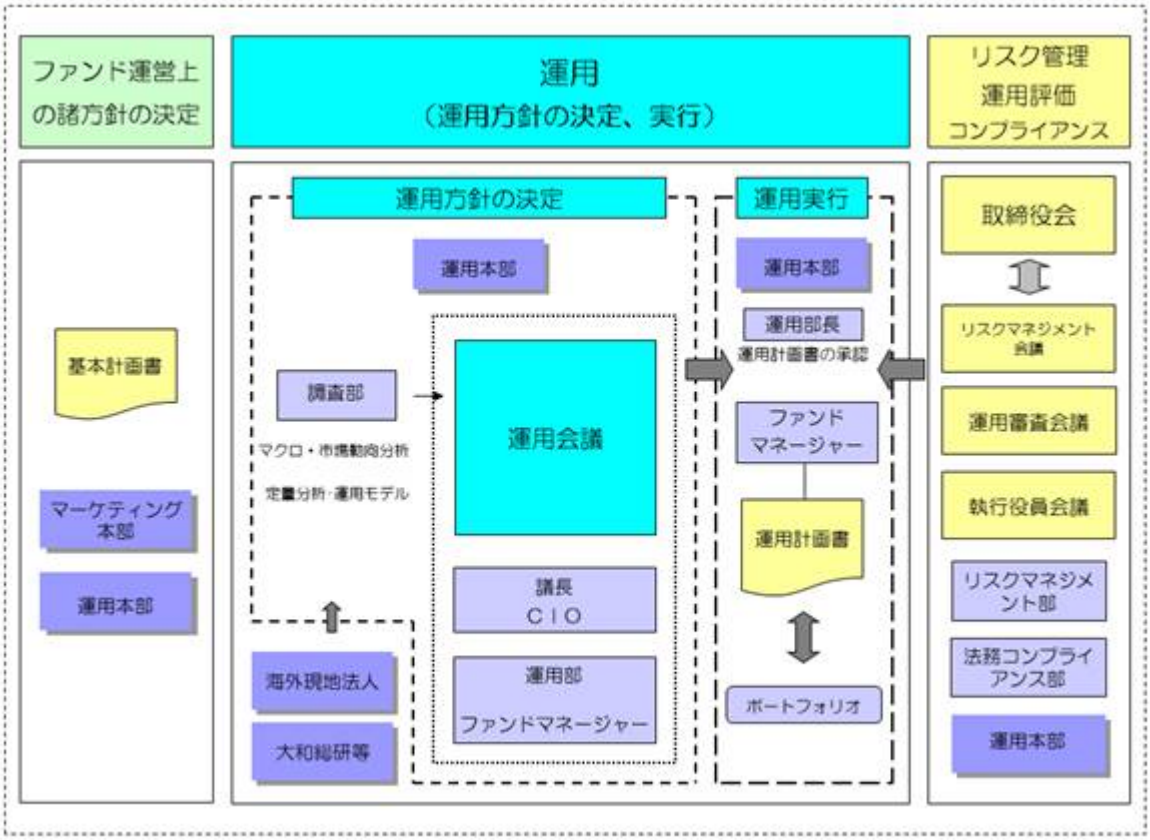
投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）
運用の基本方針	主として、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。
主要な投資対象	世界の株式およびオプション
委託会社等の名称	投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシー 副投資顧問会社：ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ 通貨運用助言会社：大和アセットマネジメント株式会社

くわしくは、「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



②　運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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。

ハ．運用計画書の作成・承認

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。

③　職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（2名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．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。

ロ．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。

ハ．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。

⑤　受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※　上記の運用体制は2020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。

(4)　【分配方針】

＜各ファンド共通＞

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)　【投資制限】

＜各ファンド共通＞

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

④　信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑤　資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞投資対象ファンドについて

1. ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・クラス）
2. ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
3. ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）

「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

4. ダイワ・マネーストック・マザーファンド

※下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 　株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行ないません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

3　【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式への投資とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

②　カバードコール戦略の利用に伴うリスク

オプションプレミアムの水準は、オプション売却時の株価水準、権利行使価格、株価変動率（ボラティリティ）、満期日までの期間、金利水準、配当金額、需給等により決定されます。想定したオプションプレミアムが確保できない場合もあります。

株価水準や株価変動率の変動等によりコール・オプションの評価値が変動し、損失を被る場合があります。

カバードコール戦略では、株価が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、株式のみに投資した場合に対して投資成果が劣後する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、株価が下落しその後当初の水準程度まで回復しても、基準価額の回復は株価に比べて緩やかになる可能性があります。

③　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉

※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

取引対象通貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。

取引対象通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

特に、新興国通貨の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

為替取引を活用して、取引対象通貨で実質的な運用を行なうことをめざしますが、投資対象資産の通貨である原資産通貨の為替変動リスクを完全に排除することはできません。取引対象通貨の金利が原資産通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※各ファンドの投資対象である外国投資信託において、ＮＤＦ取引を用いて為替取引を行なう場合、コストは需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが株式市場や為替市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

⑤　その他

イ．解約資金を手当てするためカバードコール戦略を解消（株式の売却およびオプションの買戻し）する際、市場規模や市場動向によっては当初期待される価格で解消できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

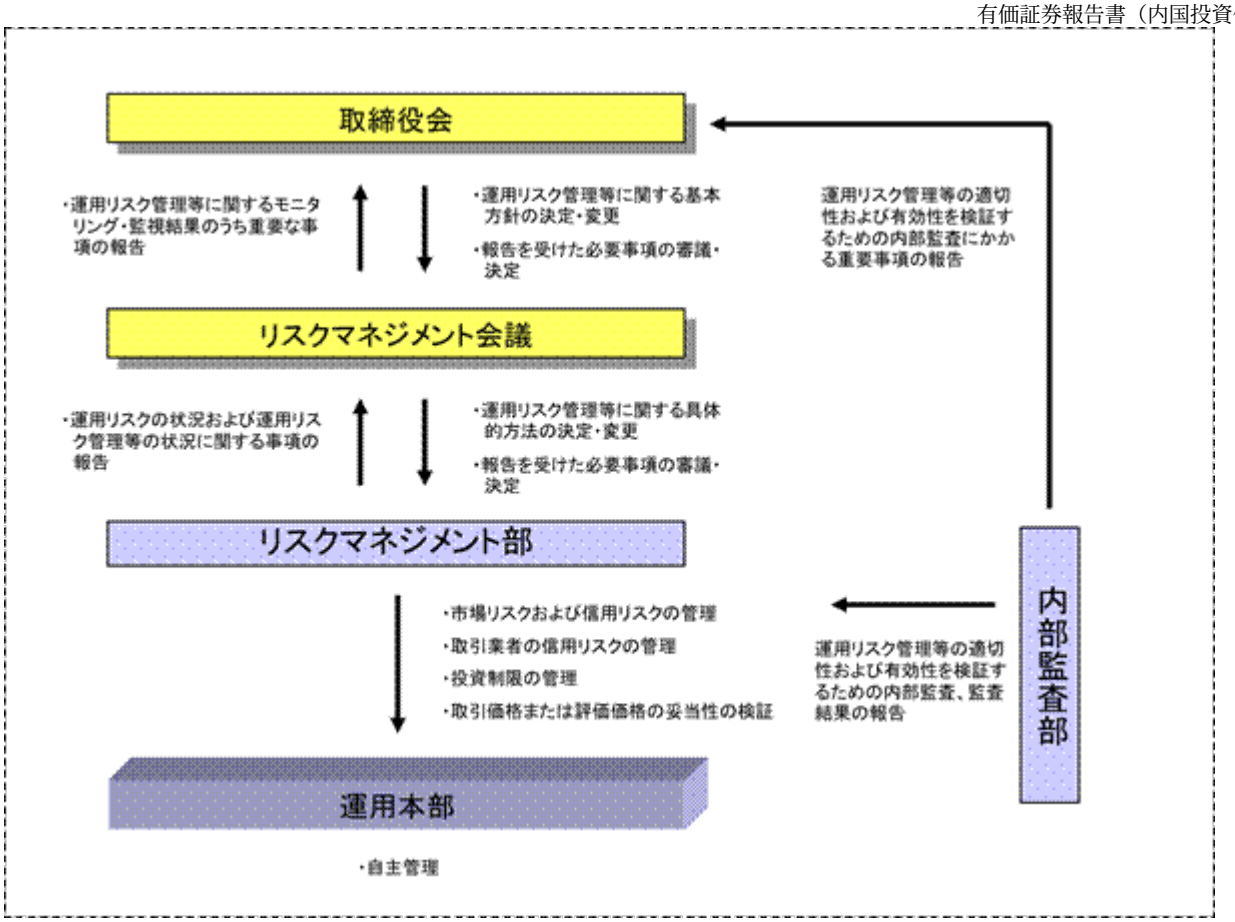
②　ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

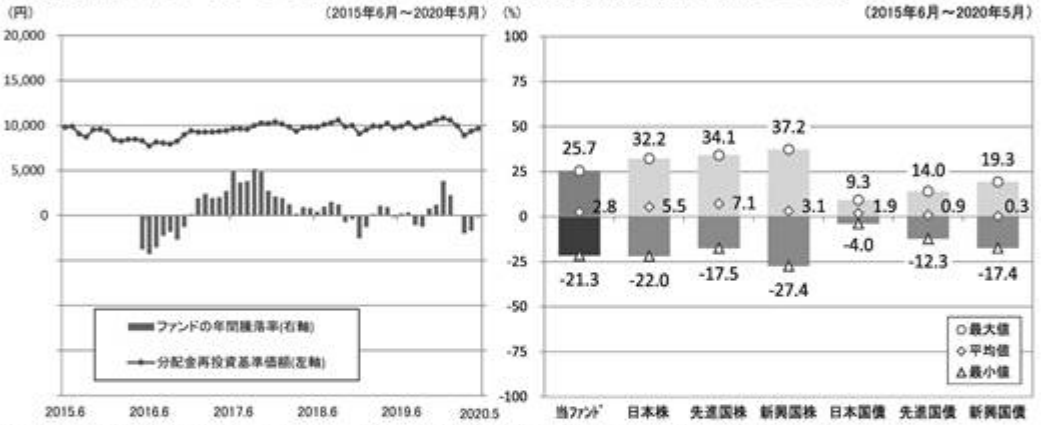
参考情報

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

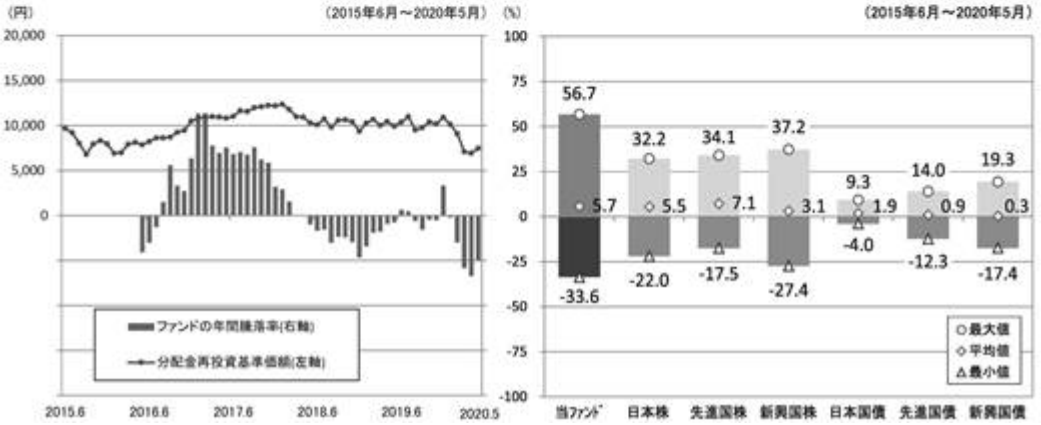
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

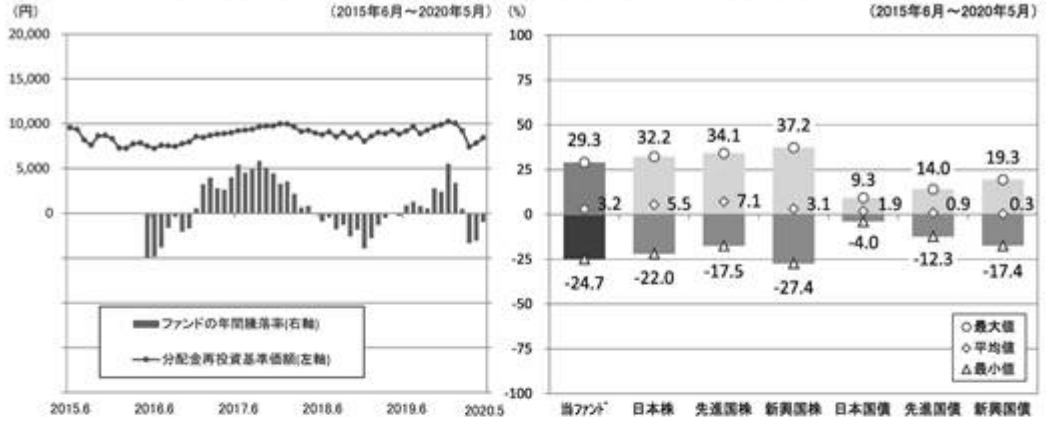
［通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース］



［通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース］



[通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) 通貨セレクト・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：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ 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。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ 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】

①　販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

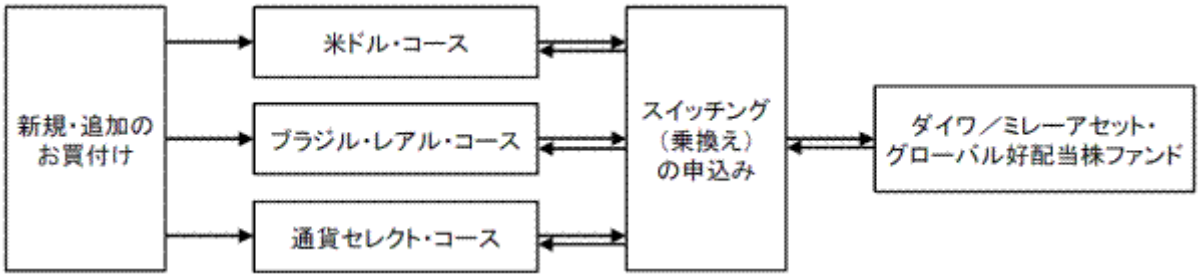
・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）

＜スイッチング（乗換え）について＞

・「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）」の各コースおよび「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」により構成される各ファンドの受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって、他の構成ファンドの受益権の取得申込みを行なうことをいいます。

・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
・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。

（「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）」および「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」の構成）



② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2) 【換金(解約)手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
信託終了前の解約の際に1万口当たり一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額の0.2%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.298%（税抜1.18%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、純資産総額に対し次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.80% （税抜）	年率0.03% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④　前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

⑤　当ファンドの信託報酬等のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬等がかかります。当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬等を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、「通貨セレクト・コース」以外については年率1.998%（税込）程度、「通貨セレクト・コース」については年率2.148%（税込）程度です。（投資対象ファンド「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額13,500米ドルがかかりますので、純資産総額によっては上回る場合があります。）

（注）投資対象ファンドの信託報酬等については、「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」の「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

①　信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③　信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④　信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（※）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜投資対象ファンドより支弁する手数料等＞

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収※され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（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含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※） 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2020年5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。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

ます。

5　【運用状況】

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース】

(1) 【投資状況】（2020年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		444,681,421	98.29
	内　ケイマン諸島	444,681,421	98.29
親投資信託受益証券		1,991,638	0.44
	内　日本	1,991,638	0.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,758,159	1.27
純資産総額		452,431,218	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】（2020年5月29日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND USD CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	7,318,533.61	60.20 440,612,316	60.76 444,681,421	98.29
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,989,053	1.0013 1,991,638	1.0013 1,991,638	0.44

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.29%
親投資信託受益証券	0.44%
合計	98.73%

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2015年11月24日)	5,131,125,859	5,164,192,136	0.9311	0.9371
第2特定期間末 (2016年5月23日)	3,982,263,337	4,013,810,126	0.7574	0.7634
第3特定期間末 (2016年11月21日)	2,860,942,367	2,883,345,908	0.7662	0.7722
第4特定期間末 (2017年5月22日)	1,944,476,804	1,954,149,326	0.8041	0.8081
第5特定期間末 (2017年11月21日)	1,348,184,798	1,354,571,673	0.8443	0.8483
第6特定期間末 (2018年5月21日)	947,579,405	952,234,263	0.8143	0.8183
第7特定期間末 (2018年11月21日)	694,433,831	698,114,225	0.7547	0.7587
第8特定期間末 (2019年5月21日)	590,647,619	593,801,721	0.7491	0.7531
2019年5月末日	560,883,736	－	0.7373	－
6月末日	563,058,134	－	0.7463	－
7月末日	573,976,023	－	0.7696	－
8月末日	543,277,440	－	0.7276	－
9月末日	546,119,671	－	0.7375	－
10月末日	550,415,064	－	0.7569	－

第9特定期間末 (2019年11月21日)	551,497,592	554,382,011	0.7648	0.7688
11月末日	558,613,902	－	0.7768	－
12月末日	570,041,198	－	0.7899	－
2020年1月末日	519,712,107	－	0.7688	－
2月末日	476,603,647	－	0.7198	－
3月末日	421,707,641	－	0.6386	－
4月末日	440,781,146	－	0.6688	－
第10特定期間末 (2020年5月21日)	447,649,147	450,285,244	0.6793	0.6833
5月末日	452,431,218	－	0.6852	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0300
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0240
第5特定期間	0.0240
第6特定期間	0.0240
第7特定期間	0.0240
第8特定期間	0.0240
第9特定期間	0.0240
第10特定期間	0.0240

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	△3.9
第2特定期間	△14.8
第3特定期間	5.9
第4特定期間	8.1
第5特定期間	8.0
第6特定期間	△0.7
第7特定期間	△4.4
第8特定期間	2.4
第9特定期間	5.3
第10特定期間	△8.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	633,574,380	223,974,352
第2特定期間	231,295,430	484,543,392
第3特定期間	57,862,250	1,581,736,854
第4特定期間	22,442,437	1,338,235,340
第5特定期間	15,718,764	837,130,641
第6特定期間	18,888,720	451,892,940
第7特定期間	24,898,244	268,514,157
第8特定期間	19,699,204	151,272,405
第9特定期間	7,777,101	75,197,756
第10特定期間	16,837,631	78,918,041

(注)　当初設定数量は5,101,446,187口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	81,813,632,694	100.00
純資産総額	81,813,632,694	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（2020年5月29日現在）

① 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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース

2020年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	6,852円
純資産総額	4.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.1%
3カ月間	−3.0%
6カ月間	−8.8%
1年間	−0.8%
3年間	2.5%
5年間	−5.4%
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：　480円　　設定来分配金合計額：　2,700円

決算期	第 48 期 19年6月	第 49 期 19年7月	第 50 期 19年8月	第 51 期 19年9月	第 52 期 19年10月	第 53 期 19年11月	第 54 期 19年12月	第 55 期 20年1月	第 56 期 20年2月	第 57 期 20年3月	第 58 期 20年4月	第 59 期 20年5月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40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。

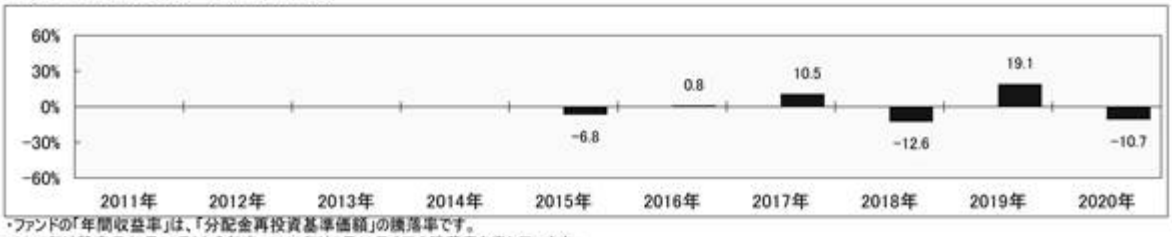
主要な資産の状況

※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
ﾐﾚｰｱｾｯﾄ・ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ・ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ（米国）ｴﾙｴﾙｼｰ／ﾐﾚｰｱｾｯﾄ・ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ・ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ	ﾐﾚｰｱｾｯﾄ・ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ・ﾊｲ・ﾃﾞｨｳﾞｨﾃﾞﾝﾄﾞ・ｴｸｲﾃｨ・ｱﾙﾌｧ・ﾌｧﾝﾄﾞ（米ﾄﾞﾙ・ｸﾗｽ）	98.3%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.4%
合計		98.7%

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（5月22日）から年末、2020年は5月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース】

(1) 【投資状況】（2020年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		588,314,627	98.46
	内 ケイマン諸島	588,314,627	98.46
親投資信託受益証券		2,981,989	0.50
	内 日本	2,981,989	0.50
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,190,336	1.04
純資産総額		597,486,952	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】（2020年5月29日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND BRL CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	18,608,129.66	29.54 549,851,623	31.61 588,314,627	98.46
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,978,118	1.0013 2,981,989	1.0013 2,981,989	0.50

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.46%
親投資信託受益証券	0.50%
合計	98.96%

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2015年11月24日)	11,118,835,234	11,297,175,998	0.7793	0.7918
第2特定期間末 (2016年5月23日)	8,970,831,973	9,143,667,378	0.6488	0.6613
第3特定期間末 (2016年11月21日)	6,710,697,009	6,834,730,653	0.6763	0.6888
第4特定期間末 (2017年5月22日)	4,357,843,712	4,404,986,027	0.7395	0.7475
第5特定期間末 (2017年11月21日)	3,201,748,501	3,234,483,039	0.7825	0.7905
第6特定期間末 (2018年5月21日)	2,263,327,778	2,291,392,817	0.6452	0.6532
第7特定期間末 (2018年11月21日)	1,762,293,053	1,786,593,875	0.5802	0.5882
第8特定期間末 (2019年5月21日)	1,424,374,868	1,438,421,843	0.5070	0.5120
2019年5月末日	1,419,530,462	―	0.5178	―
6月末日	1,314,221,838	―	0.5364	―
7月末日	1,331,264,635	―	0.5627	―
8月末日	1,136,372,064	―	0.4828	―
9月末日	1,098,666,921	―	0.4899	―
10月末日	1,112,327,275	―	0.5177	―
第9特定期間末 (2019年11月21日)	1,055,378,992	1,065,951,057	0.4991	0.5041
11月末日	1,056,815,702	―	0.5003	―
12月末日	1,094,319,978	―	0.5321	―
2020年1月末日	1,000,876,007	―	0.4899	―

2月末日	878,522,180	―	0.4342	―
3月末日	590,441,465	―	0.3335	―
4月末日	570,935,750	―	0.3215	―
第10特定期間末 (2020年5月21日)	562,937,605	571,771,822	0.3186	0.3236
5月末日	597,486,952	―	0.3404	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0625
第2特定期間	0.0750
第3特定期間	0.0750
第4特定期間	0.0480
第5特定期間	0.0480
第6特定期間	0.0480
第7特定期間	0.0480
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	△15.8
第2特定期間	△7.1
第3特定期間	15.8
第4特定期間	16.4
第5特定期間	12.3
第6特定期間	△11.4
第7特定期間	△2.6
第8特定期間	△5.4
第9特定期間	4.4
第10特定期間	△30.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	1,192,257,910	520,139,184
第2特定期間	573,767,967	1,014,196,695
第3特定期間	417,529,711	4,321,670,538

第4特定期間	355,250,034	4,385,152,245
第5特定期間	148,657,979	1,949,630,113
第6特定期間	96,569,996	680,257,335
第7特定期間	43,037,099	513,564,182
第8特定期間	55,332,381	283,540,122
第9特定期間	37,245,943	732,227,855
第10特定期間	24,451,696	372,021,443

（注）　当初設定数量は13,595,142,428口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース

2020年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	3,404円
純資産総額	5.9億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	7.5%
3カ月間	−17.9%
6カ月間	−26.6%
1年間	−24.8%
3年間	−31.1%
5年間	−24.4%
設定来	−25.5%

※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：　600円　　設定来分配金合計額：　5,065円

決算期	第48期 19年6月	第49期 19年7月	第50期 19年8月	第51期 19年9月	第52期 19年10月	第53期 19年11月	第54期 19年12月	第55期 20年1月	第56期 20年2月	第57期 20年3月	第58期 20年4月	第59期 20年5月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円

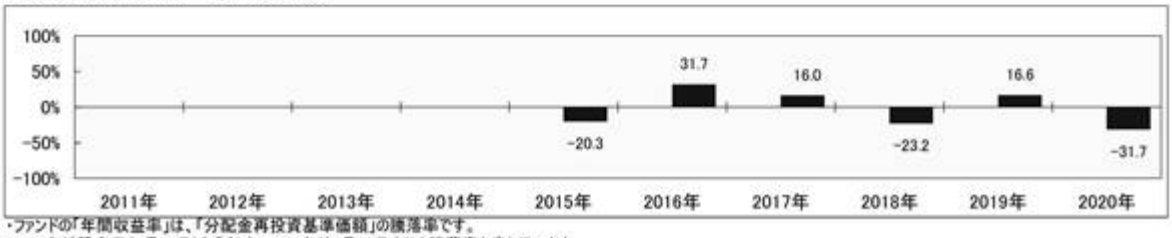
※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ(米国)ｴﾙｴﾙｼｰ/ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ	ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ﾊｲ･ﾃﾞｨｳﾞｨﾃﾞﾝﾄﾞ･ｴｸｲﾃｨ･ｱﾙﾌｧ･ﾌｧﾝﾄﾞ(ﾌﾞﾗｼﾞﾙ･ﾚｱﾙ･ｸﾗｽ)	98.5%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.5%
合計		99.0%

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（5月22日）から年末、2020年は5月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース】

(1)　【投資状況】（2020年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		307,825,063	96.29
	内 ケイマン諸島	307,825,063	96.29
親投資信託受益証券		1,693,439	0.53
	内 日本	1,693,439	0.53
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,154,131	3.18
純資産総額		319,672,633	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】（2020年5月29日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND CURRENCY SELECT CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	8,733,121.39	34.71 303,187,775	35.24 307,825,063	96.29
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,691,241	1.0013 1,693,439	1.0013 1,693,439	0.53

(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	96.29%
親投資信託受益証券	0.53%
合計	96.82%

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2015年11月24日)	3,305,985,440	3,349,700,475	0.8319	0.8429
第2特定期間末 (2016年5月23日)	2,327,145,033	2,367,975,064	0.6270	0.6380
第3特定期間末 (2016年11月21日)	1,499,537,249	1,527,471,303	0.5905	0.6015
第4特定期間末 (2017年5月22日)	1,151,445,526	1,164,115,269	0.6362	0.6432
第5特定期間末 (2017年11月21日)	995,860,165	1,006,734,072	0.6411	0.6481
第6特定期間末 (2018年5月21日)	748,159,384	757,298,911	0.5730	0.5800
第7特定期間末 (2018年11月21日)	551,213,557	559,179,474	0.4844	0.4914
第8特定期間末 (2019年5月21日)	462,862,097	469,737,356	0.4713	0.4783
2019年5月末日	459,430,129	－	0.4672	－
6月末日	466,733,777	－	0.4783	－
7月末日	485,329,370	－	0.4965	－
8月末日	442,234,980	－	0.4499	－
9月末日	454,679,927	－	0.4620	－
10月末日	461,165,529	－	0.4745	－
第9特定期間末 (2019年11月21日)	431,645,929	438,028,019	0.4734	0.4804
11月末日	438,183,167	－	0.4788	－
12月末日	428,334,594	－	0.4888	－
2020年1月末日	413,492,538	－	0.4724	－
2月末日	375,900,381	－	0.4273	－
3月末日	293,525,407	－	0.3364	－
4月末日	299,373,643	－	0.3480	－

第10特定期間末 (2020年5月21日)	307,494,588	313,447,118	0.3616	0.3686
5月末日	319,672,633	―	0.3669	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0550
第2特定期間	0.0660
第3特定期間	0.0660
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	△11.3
第2特定期間	△16.7
第3特定期間	4.7
第4特定期間	14.9
第5特定期間	7.4
第6特定期間	△4.1
第7特定期間	△8.1
第8特定期間	6.0
第9特定期間	9.4
第10特定期間	△14.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	189,289,465	33,734,960
第2特定期間	79,252,291	341,525,351
第3特定期間	54,585,562	1,226,947,134
第4特定期間	36,280,190	765,776,315
第5特定期間	58,324,866	314,872,923
第6特定期間	19,631,544	267,400,018

第7特定期間	6,943,557	174,602,213
第8特定期間	28,563,425	184,371,750
第9特定期間	19,498,300	89,950,965
第10特定期間	24,342,871	85,708,587

（注）　当初設定数量は3,818,539,632口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース

2020年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	3,669円
純資産総額	3.1億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	7.5%
3カ月間	−8.7%
6カ月間	−15.0%
1年間	−4.8%
3年間	−6.5%
5年間	−15.5%
設定来	−15.8%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　840円　　設定来分配金合計額：　4,810円

決算期	第48期 19年6月	第49期 19年7月	第50期 19年8月	第51期 19年9月	第52期 19年10月	第53期 19年11月	第54期 19年12月	第55期 20年1月	第56期 20年2月	第57期 20年3月	第58期 20年4月	第59期 20年5月
分配金	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額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

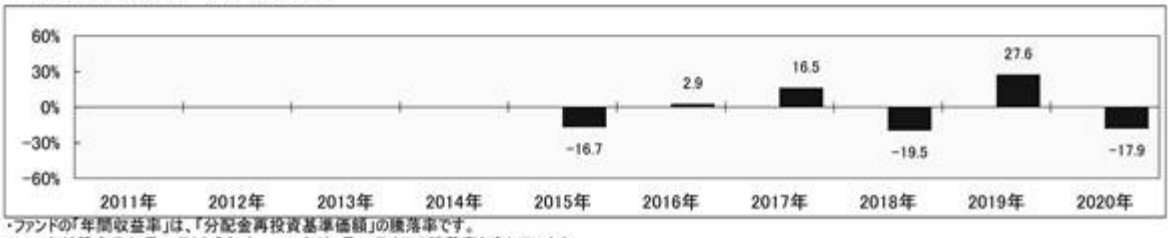
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ（米国）ｴﾙｴﾙｼｰ/ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ｲﾝﾍﾞｽﾄﾒﾝﾂ	ﾐﾚｰｱｾｯﾄ･ｸﾞﾛｰﾊﾞﾙ･ﾊｲ･ﾃﾞｨｳﾞｨﾃﾞﾝﾄﾞ･ｴｸｲﾃｨ･ｱﾙﾌｧ･ﾌｧﾝﾄﾞ（通貨ｾﾚｸﾄ･ｸﾗｽ）	96.3%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.5%
合計		96.8%

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（5月22日）から年末、2020年は5月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２　【管理及び運営】

１　【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、次のイ．およびロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けは行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日（当ファンドの運営および受益者に与える影響が軽微であるとして委託会社が定める日に限り除きます。）

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

２　【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、次のイ．およびロ．に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）」を構成する各ファンドの受益者が、当該ファンドの一部解約金の手取金をもって他の構成ファンドまたは「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」の受益権の取得申込みをする場合において、当該他の構成ファンドまたは「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」の受益権の取得申込みの受付けが中止された場合、委託会社は、当該一部解約請求の申込みの受付けを中止することができます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜信託財産留保額について＞

当ファンドにおいては、信託終了前の解約の際に1万口当たり一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額の0.2%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

一部解約に対応して有価証券等の取引を行なう場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを信託財産が負うことになります。

信託財産留保額は、こうしたコスト等の負担について、受益権を継続して保有される方との公平性に資する目的で導入されているもので、解約の際に控除され、信託財産に繰入れられます。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3　【資産管理等の概要】

(1)　【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・組入外国投資信託の受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
3. 価格情報会社の提供する価額

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ
アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2015年5月22日から2025年5月21日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

毎月22日から翌月21日までとします。ただし、第1計算期間は、2015年5月22日から2015年7月21日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
4. 前3. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

6. 前3. から前5. までの規定は、前2. の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3. から前5. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③　反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

④　運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年5月および11月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

https://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥　関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4　【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「２　換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第３　【ファンドの経理状況】

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）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か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2019年11月22日から2020年5月21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】

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,938,425	8,170,939
投資信託受益証券	546,078,634	440,612,315
親投資信託受益証券	1,992,036	1,991,638
流動資産合計	555,009,095	450,774,892
資産合計	555,009,095	450,774,892
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,884,419	2,636,097
未払解約金	－	1
未払受託者報酬	15,356	11,926
未払委託者報酬	588,802	457,398
その他未払費用	22,926	20,323
流動負債合計	3,511,503	3,125,745
負債合計	3,511,503	3,125,745
純資産の部		
元本等		
元本	※1 721,104,880	※1 659,024,470
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 169,607,288	※2 △ 211,375,323
（分配準備積立金）	56,506,088	60,320,355
元本等合計	551,497,592	447,649,147
純資産合計	551,497,592	447,649,147
負債純資産合計	555,009,095	450,774,892

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
営業収益		
受取配当金	29,636,401	28,442,592
受取利息	11	28
有価証券売買等損益	2,869,742	△ 63,909,309
営業収益合計	32,506,154	△ 35,466,689
営業費用		
支払利息	2,094	1,285
受託者報酬	90,695	81,554
委託者報酬	3,478,312	3,127,805
その他費用	22,985	20,331
営業費用合計	3,594,086	3,230,975
営業利益又は営業損失（△）	28,912,068	△ 38,697,664
経常利益又は経常損失（△）	28,912,068	△ 38,697,664
当期純利益又は当期純損失（△）	28,912,068	△ 38,697,664
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（△）	135,191	△ 659,091
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 197,877,916	△ 169,607,288
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,202,728	16,619,133
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	19,202,728	16,619,133
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,991,560	3,999,858
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,991,560	3,999,858
分配金	※1 17,717,417	※1 16,348,737
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 169,607,288	△ 211,375,323

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1．※1　期首元本額	788,525,535円	721,104,880円
期中追加設定元本額	7,777,101円	16,837,631円
期中一部解約元本額	75,197,756円	78,918,041円
2．特定期間末日における受益権の総数	721,104,880口	659,024,470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169,607,288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211,375,323円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
※1　分配金の計算過程	（自2019年5月22日　至2019年6月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,374,486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（3,574,280円）及び分配準備積立金（49,937,153円）より分配対象額は57,885,919円（1万口当たり768.58円）であり、うち3,012,611円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2019年11月22日　至2019年12月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,082,667円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,795,417円）及び分配準備積立金（55,612,364円）より分配対象額は65,490,448円（1万口当たり908.84円）であり、うち2,882,383円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

		（自2019年6月22日　至2019年7月22日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,837,466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（3,620,341円）及び分配準備積立金（50,630,398円）より分配対象額は59,088,205円（1万口当たり793.55円）であり、うち2,978,431円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2019年7月23日　至2019年8月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,648,719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（3,712,266円）及び分配準備積立金（52,455,850円）より分配対象額は60,816,835円（1万口当たり815.92円）であり、うち2,981,527円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2019年12月24日　至2020年1月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,782,582円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,897,441円）及び分配準備積立金（57,812,547円）より分配対象額は67,492,570円（1万口当たり935.11円）であり、うち2,887,037円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2020年1月22日　至2020年2月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,057,790円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,631,983円）及び分配準備積立金（55,254,176円）より分配対象額は63,943,949円（1万口当たり955.76円）であり、うち2,676,138円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	

		（自2019年8月22日　至2019年9月24日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,597,695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（3,779,778円）及び分配準備積立金（53,578,937円）より分配対象額は61,956,410円（1万口当たり838.11円）であり、うち2,956,957円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2019年9月25日　至2019年10月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,145,610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（3,806,333円）及び分配準備積立金（54,125,937円）より分配対象額は62,077,880円（1万口当たり855.22円）であり、うち2,903,472円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2020年2月22日　至2020年3月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,860,430円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,634,684円）及び分配準備積立金（55,714,325円）より分配対象額は64,209,439円（1万口当たり974.35円）であり、うち2,635,997円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2020年3月24日　至2020年4月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,433,522円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,745,691円）及び分配準備積立金（56,713,038円）より分配対象額は65,892,251円（1万口当たり1,001.75円）であり、うち2,631,085円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	

	（自2019年10月22日　至2019年11月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,483,013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（3,878,633円）及び分配準備積立金（54,907,494円）より分配対象額は63,269,140円（1万口当たり877.39円）であり、うち2,884,419円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2020年4月22日　至2020年5月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,441,815円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,867,080円）及び分配準備積立金（58,514,637円）より分配対象額は67,823,532円（1万口当たり1,029.15円）であり、うち2,636,097円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2020年5月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	14,940,808	8,041,191
親投資信託受益証券	△199	0
合計	14,940,609	8,041,191

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7648円 (7,648円)	0.6793円 (6,793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	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND USD CLASS	7,318,533.610	440,612,315	
投資信託受益証券　合計			440,612,315	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	1,989,053	1,991,638	
親投資信託受益証券　合計			1,991,638	
合計			442,603,953	

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－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・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・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（米ドル・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
2018年10月31日

資産		
投資資産の評価額（簿価 $25,656,502）	$	26,086,118
現金		4,596
外国為替先渡契約による評価益		416,682
未収：		
売却済みの投資		58,350
配当		13,691
カウンターパーティへの預託金		15,000
未収変動証拠金		1,859,758
資産合計		28,454,195
負債		
外国為替先渡契約による評価損		45,206
売建てオプションの評価額（受取プレミアム $155,094）		204,904
カウンターパーティに対する支払		300,000
保管会社に対する支払		10,367
未払：		
専門家報酬		41,573
運用会社報酬		13,318
保管会社報酬		12,734
会計および管理会社報酬		7,892
為替取引執行会社報酬		2,651
名義書換代理人報酬		1,212
為替投資アドバイザー報酬		1,088
負債合計		640,945
純資産	$	27,813,250
純資産		
ブラジル・レアル・クラス	$	16,413,541
通貨セレクト・クラス		5,084,244
米ドル・クラス		6,315,465

	$	27,813,250
発行済み受益証券（口数）		
ブラジル・レアル・クラス		32,858,971
通貨セレクト・クラス		12,181,115
米ドル・クラス		9,700,548
受益証券1口当り純資産額		
ブラジル・レアル・クラス	$	0.500
通貨セレクト・クラス	$	0.417
米ドル・クラス	$	0.651

損益計算書
2018年10月31日に終了した年度

投資収益		
配当収益（源泉徴収税 $218,816控除後）	$	795,352
受取利息		59,845
投資収益合計		855,197
費用		
運用会社報酬		226,134
保管会社報酬		54,771
会計および管理会社報酬		44,877
専門家報酬		36,845
受託会社報酬		18,204
為替取引執行会社報酬		11,306
為替投資アドバイザー報酬		10,439
名義書換代理人報酬		7,391
登録料		2,088
その他費用		9
費用合計		412,064
投資純利益		443,133
実現利益（損失）および評価益（損）：		
実現利益（損失）：		
証券投資		5,592,596
先物取引		333,570
売建オプション		(832,823)
外国為替取引および外国為替先渡契約		(3,785,382)
純実現利益		1,307,961
評価益（損）の純変動：		
証券投資		(5,612,370)
売建オプション		56,951
先物取引		(250,602)
外国為替換算および外国為替先渡契約		1,220,024
評価益（損）の純変動		(4,585,997)
純実現・純評価損		(3,278,036)
運用による純資産の純減	$	(2,834,903)

投資明細表
2018年10月31日

株数	証券の明細		評価額
	普通株（78.8%）		
	オーストラリア（2.0%）		
	銀行（2.0%）		
4,166	Commonwealth Bank of Australia (a)	$	204,412

4,166	Macquarie Group, Ltd. (a)	346,051
	オーストラリア合計 (簿価 $641,604)	550,463
	カナダ (0.9%)	
	銀行 (0.9%)	
5,400	National Bank of Canada	245,729
	カナダ合計 (簿価 $262,185)	245,729
	中国 (8.6%)	
	自動車 (0.7%)	
189,000	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. Class H	191,184
	銀行 (3.2%)	
586,000	Bank of China, Ltd. Class H	249,667
398,000	China Construction Bank Corp. Class H	315,784
480,000	Industrial & Commercial Bank of China, Ltd. Class H	324,515
		889,966
	石炭 (0.7%)	
83,000	China Shenhua Energy Co., Ltd. Class H	188,035
	商業サービス (0.3%)	
71,000	Jiangsu Expressway Co., Ltd. Class H	95,278
	電力 (0.4%)	
213,000	Huaneng Power International, Inc. Class H	118,735
	食品 (0.3%)	
116,000	Want Want China Holdings, Ltd.	82,863
	保険 (0.7%)	
211,500	PICC Property & Casualty Co., Ltd. Class H	205,041
	鉱業 (0.8%)	
594,000	Zijin Mining Group Co., Ltd. Class H	220,494
	石油・ガス (1.1%)	
181,000	CNOOC, Ltd.	310,771
	小売 (0.4%)	
45,400	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. Class H	100,305
	中国合計 (簿価 $2,430,002)	2,402,672
	フランス (4.5%)	
	航空宇宙・防衛 (0.5%)	
1,300	Airbus SE	143,923
	アパレル (0.7%)	
200	Kering S.A.	89,194
300	LVMH Moet Hennessy Louis Vuittion SE	91,369
		180,563
	自動車 (0.1%)	
300	Renault S.A.	22,458
	銀行 (0.5%)	
1,400	BNP Paribas S.A.	73,175
4,700	Credit Agricole S.A.	60,325
		133,500
	コンピューター (0.5%)	
1,200	Capgemini SE	146,843
	電力 (0.4%)	
7,200	Engie S.A.	96,060
	エンジニアリング・建設 (0.6%)	
2,000	Vinci S.A.	178,750
	保険 (0.4%)	
4,500	AXA S.A.	112,886
	石油・ガス (0.2%)	
1,000	Total S.A.	58,873
	医薬品 (0.4%)	
1,300	Sanofi	116,129
	通信 (0.2%)	
3,900	Orange S.A.	61,069
	フランス合計 (簿価 $1,296,334)	1,251,054
	ドイツ (1.9%)	
	航空 (0.2%)	

2,500	Deutsche Lufthansa AG	50,307
	自動車 (0.1%)	
400	Daimler AG	23,731
	化学 (0.8%)	
1,400	BASF SE	107,914
1,800	Covestro AG (b)	116,496
		224,410
	家庭用品 (0.1%)	
400	Henkel AG & Co. KGaA	39,249
	保険 (0.4%)	
600	Allianz SE	125,388
	ソフトウェア (0.3%)	
700	SAP SE	75,078
	ドイツ合計 (簿価 $660,146)	538,163
	香港 (1.2%)	
	総合持株会社 (0.4%)	
11,544	CK Hutchison Holdings, Ltd.	116,259
	不動産 (0.3%)	
13,044	CK Asset Holdings, Ltd.	84,692
	通信 (0.5%)	
13,500	China Mobile, Ltd.	126,228
	香港合計 (簿価 $406,451)	327,179
	オランダ (0.9%)	
	銀行 (0.3%)	
3,000	ABN AMRO Group NV (b)	73,761
	石油・ガス (0.6%)	
5,700	Royal Dutch Shell PLC Class A	182,116
	オランダ合計 (簿価 $247,204)	255,877
	ノルウェー (0.2%)	
	通信 (0.2%)	
3,400	Telenor ASA	62,560
	ノルウェー合計 (簿価 $71,216)	62,560
	スペイン (0.0%)	
	銀行 (0.0%)	
1,800	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	9,963
	スペイン合計 (簿価 $15,256)	9,963
	スイス (1.7%)	
	食品 (0.9%)	
2,800	Nestle S.A.	236,938
	医薬品 (0.8%)	
1,300	Novartis AG	114,039
500	Roche Holding AG	121,832
		235,871
	スイス合計 (簿価 $450,709)	472,809
	英国 (3.1%)	
	農業 (0.4%)	
1,300	British American Tobacco PLC	56,368
1,800	Imperial Brands PLC	61,018
		117,386
	銀行 (0.5%)	
18,100	HSBC Holdings PLC	149,148
	化粧品・パーソナルケア (0.5%)	
2,700	Unilever NV	145,390
	鉱業 (0.6%)	
3,300	Rio Tinto PLC	160,377
	医薬品 (0.5%)	
6,700	GlaxoSmithKline PLC	129,373
	運用会社 (0.3%)	
6,200	3i Group PLC	69,572
	通信 (0.3%)	
42,800	Vodafone Group PLC	80,839

	英国合計（簿価 $921,647)	852,085
	米国（53.8%)	
	航空宇宙・防衛（4.2%)	
3,300	Boeing Co.	1,171,038
	農業（1.3%)	
5,500	Altria Group, Inc.	357,720
	航空（0.8%)	
4,100	Delta Air Lines, Inc.	224,393
	自動車（0.5%)	
3,700	General Motors Co.	135,383
	銀行（3.8%)	
15,300	Bank of America Corp.	420,750
6,300	Citigroup, Inc.	412,398
200	Goldman Sachs Group, Inc.	45,074
3,900	Morgan Stanley	178,074
		1,056,296
	バイオテクノロジー（1.4%)	
1,000	Amgen, Inc.	192,790
2,800	Gilead Sciences, Inc.	190,904
		383,694
	化学（1.1%)	
3,300	DowDuPont, Inc.	177,936
1,600	LyondellBasell Industries NV Class A	142,832
		320,768
	コンピューター（4.3%)	
3,200	Apple, Inc.	700,352
400	Cognizant Technology Solutions Corp. Class A	27,612
9,500	HP, Inc.	229,330
3,200	NetApp, Inc.	251,168
		1,208,462
	化粧品・パーソナルケア（1.0%)	
3,000	Procter & Gamble Co.	266,040
	総合金融サービス（6.0%)	
1,700	American Express Co.	174,641
2,400	Discover Financial Services	167,208
2,300	Mastercard, Inc. Class A	454,641
6,300	Visa, Inc. Class A	868,455
		1,664,945
	電力（0.4%)	
3,700	CenterPoint Energy, Inc.	99,937
	食品（1.2%)	
5,500	Tyson Foods, Inc. Class A	329,560
	ヘルスケアサービス（2.8%)	
1,400	Anthem, Inc.	385,798
1,500	UnitedHealth Group, Inc.	392,025
		777,823
	保険（1.2%)	
7,500	Aflac, Inc.	323,025
	宿泊施設（0.6%)	
1,500	Marriott International, Inc. Class A	175,335
	メディア（1.8%)	
4,500	Comcast Corp. Class A	171,630
3,000	Walt Disney Co.	344,490
		516,120
	その他製造（0.2%)	
900	Eaton Corp. PLC	64,503
	石油・ガス（1.2%)	
1,100	Chevron Corp.	122,815
1,500	Exxon Mobil Corp.	119,520
1,100	Valero Energy Corp.	100,199
		342,534

		医薬品 (3.4%)			
	1,800	CVS Health Corp.			130,302
	3,000	Johnson & Johnson			419,970
	9,500	Pfizer, Inc.			409,070
					959,342
		小売 (5.2%)			
	3,000	Best Buy Co., Inc.			210,480
	1,700	Costco Wholesale Corp.			388,671
	1,100	Home Depot, Inc.			193,468
	1,000	McDonald's Corp.			176,900
	2,400	Ross Stores, Inc.			237,600
	2,100	TJX Cos., Inc.			230,748
					1,437,867
		半導体 (1.4%)			
	2,200	Applied Materials, Inc.			72,336
	1,400	Broadcom, Inc.			312,886
					385,222
		ソフトウェア (6.6%)			
	16,900	Microsoft Corp.			1,805,089
	400	Oracle Corp.			19,536
					1,824,625
		通信 (3.4%)			
	11,500	AT&T, Inc.			352,820
	12,700	Cisco Systems, Inc.			581,025
					933,845
		米国合計 (簿価 $14,094,661)			14,958,477
		普通株合計 (簿価 $21,497,415)		$	21,927,031
	元本	**短期投資 (15.0%)**	**純資産に占める比率**		
		ケイマン諸島 (0.0%)			
		定期預金 (0.0%)			
		Brown Brothers Harriman & Co.			
NOK	1	0.30% due 2018/11/1		$	0*
JPY	88	-0.30% due 2018/11/1			1
GBP	12	0.36% due 2018/11/1			15
HKD	79	0.37% due 2018/11/1			10
AUD	405	0.77% due 2018/11/1			287
		定期預金合計			**313**
		ケイマン諸島合計 (簿価 $313)			**313**
		シンガポール (15.0%)			
		定期預金 (15.0%)			
		DBS Bank, Ltd.			
USD	4,158,774	1.44% due 2018/11/1			4,158,774
		定期預金合計			**4,158,774**
		シンガポール合計 (簿価 $4,158,774)			**4,158,774**
		短期投資合計 (簿価 $4,159,087)			**4,159,087**
		投資総額 (簿価 $25,656,502)	**93.8%**	**$**	**26,086,118**
		負債を超過する現金およびその他の資産	**6.2**		**1,727,132**
		純資産	**100.0%**	**$**	**27,813,250**

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す。

* $0.50未満

(a)コールオプションを売建てした証券。

(b) 144A証券 - 1933年証券法の規則144Aのもと登録が免除されている証券。同証券は、登録が免除されている取引によって転売できます。取引の買い手は通常は適格機関投資家。別段の記載がない限り、同証券は非流動資産とみなされません。

2018年10月31日現在、以下に開示している先物取引および売建てオプションのために$1,915,983の現金をブローカーが保有しています。

2018年10月31日現在の売建て株式オプション（純資産の-0.0%）:

明細	行使価格	満期日	建玉数	受取プレミアム	評価額
Call - Commonwealth Bank of Australia	$ 68.00	2018/11/29	41	$ (1,814)	$ (5,812)
Call - Macquarie Group, Ltd.	116.00	2018/11/29	41	(3,555)	(9,299)
				$ (5,369)	$ (15,111)

2018年10月31日現在の売建てインデックスオプション（純資産の-0.7%）:

明細	行使価格	満期日	建玉数	受取プレミアム	評価額
Call - Euro Stoxx 50	$ 3,300.00	2018/11/16	30	$ (8,188)	$ (3,093)
Call - Euro Stoxx 50	3,250.00	2018/11/16	75	(14,462)	(20,480)
Call - FTSE 100 Index	7,300.00	2018/12/21	10	(6,843)	(9,455)
Call - Hang Seng China Enterprises Index	10,700.00	2018/11/29	37	(16,416)	(21,475)
Call - S&P 500 Index	2,775.00	2018/11/16	35	(53,143)	(56,700)
Call - S&P 500 Index	2,750.00	2018/11/16	29	(50,673)	(78,590)
				$ (149,725)	$ (189,793)

2018年10月31日現在の先物取引（純資産の-0.1%）:

ポジション	明細	限月	建玉数	評価益（損）
Long	Euro Stoxx 50 Futures	2018年12月	44	$ (57,400)
Long	NASDAQ 100 E-Mini Futures	2018年12月	10	9,550
Long	S&P 500 E-Mini Futures	2018年12月	10	6,625
				$ (41,225)

2018年10月31日現在のブラジル・レアル・クラスの外国為替先渡契約（純資産の1.0%）:

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益(損)
BRL	Citibank N.A.	1,002,615	2018/11/27	AUD	373,818	$ 4,224	$ –	$ 4,224
BRL	Citibank N.A.	888,704	2018/11/27	CHF	231,769	7,732	–	7,732
BRL	Citibank N.A.	7,012,851	2018/11/27	EUR	1,603,835	62,475	–	62,475
BRL	Citibank N.A.	1,697,728	2018/11/27	GBP	339,792	21,296	–	21,296
BRL	Citibank N.A.	5,214,797	2018/11/27	HKD	10,813,767	19,671	–	19,671
BRL	Citibank N.A.	45,333,198	2018/11/27	USD	12,014,624	159,007	–	159,007
						$ 274,405	$ –	$ 274,405

2018年10月31日現在の通貨セレクト・クラスの外国為替先渡契約（純資産の0.3%）:

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益(損)
BRL	Citibank N.A.	47,650	2018/11/27	AUD	17,757	$ 208	$ –	$ 208
BRL	Citibank N.A.	42,219	2018/11/27	CHF	11,009	369	–	369
BRL	Citibank N.A.	333,215	2018/11/27	EUR	76,183	2,995	–	2,995
BRL	Citibank N.A.	80,647	2018/11/27	GBP	16,140	1,013	–	1,013
BRL	Citibank N.A.	247,778	2018/11/27	HKD	513,659	954	–	954
BRL	Citibank N.A.	2,153,946	2018/11/27	USD	570,700	7,714	–	7,714
IDR	Citibank N.A.	223,792,302	2018/11/27	AUD	20,491	148	–	148
IDR	Citibank N.A.	198,191,369	2018/11/27	CHF	12,699	344	–	344
IDR	Citibank N.A.	1,567,066,349	2018/11/27	EUR	87,817	3,064	–	3,064
IDR	Citibank N.A.	378,656,535	2018/11/27	GBP	18,623	1,010	–	1,010
IDR	Citibank N.A.	1,163,864,195	2018/11/27	HKD	592,838	623	–	623
IDR	Citibank N.A.	10,121,340,692	2018/11/27	USD	658,654	5,018	–	5,018
INR	Citibank N.A.	1,152,405	2018/11/27	AUD	21,768	104	–	104
INR	Citibank N.A.	1,020,731	2018/11/27	CHF	13,490	320	–	320
INR	Citibank N.A.	8,068,417	2018/11/27	EUR	93,295	2,865	–	2,865
INR	Citibank N.A.	1,949,200	2018/11/27	GBP	19,784	974	–	974
INR	Citibank N.A.	5,991,903	2018/11/27	HKD	629,788	369	–	369
INR	Citibank N.A.	52,102,039	2018/11/27	USD	699,703	2,713	–	2,713
MXN	Citibank N.A.	268,303	2018/11/27	AUD	19,667	–	(753)	(753)
MXN	Citibank N.A.	237,271	2018/11/27	CHF	12,191	–	(482)	(482)
MXN	Citibank N.A.	1,874,234	2018/11/27	EUR	84,336	–	(3,599)	(3,599)

MXN	Citibank N.A.	453,900	2018/11/27	GBP	17,876	–	(549)	(549)
MXN	Citibank N.A.	1,395,786	2018/11/27	HKD	568,971	–	(4,026)	(4,026)
MXN	Citibank N.A.	12,130,435	2018/11/27	USD	632,145	–	(35,797)	(35,797)
RUB	Citibank N.A.	818,790	2018/11/27	AUD	17,255	183	–	183
RUB	Citibank N.A.	725,622	2018/11/27	CHF	10,695	347	–	347
RUB	Citibank N.A.	5,729,306	2018/11/27	EUR	73,974	2,896	–	2,896
RUB	Citibank N.A.	1,385,126	2018/11/27	GBP	15,683	944	–	944
RUB	Citibank N.A.	4,257,525	2018/11/27	HKD	499,187	820	–	820
RUB	Citibank N.A.	37,013,446	2018/11/27	USD	554,609	6,619	–	6,619
TRY	Citibank N.A.	82,106	2018/11/27	AUD	18,565	1,279	–	1,279
TRY	Citibank N.A.	72,901	2018/11/27	CHF	11,502	1,365	–	1,365
TRY	Citibank N.A.	569,965	2018/11/27	EUR	79,510	9,996	–	9,996
TRY	Citibank N.A.	138,965	2018/11/27	GBP	16,872	2,870	–	2,870
TRY	Citibank N.A.	426,832	2018/11/27	HKD	537,179	6,482	–	6,482
TRY	Citibank N.A.	3,701,854	2018/11/27	USD	596,797	54,234	–	54,234
						$ 118,840	$ (45,206)	$ 73,634

2018年10月31日現在の米ドル・クラスの外国為替先渡契約（純資産の0.1%）:

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益(損)
USD	Citibank N.A.	103,726	2018/11/27	AUD	146,000	$ 220	$ –	$ 220
USD	Citibank N.A.	91,812	2018/11/27	CHF	90,475	1,665	–	1,665
USD	Citibank N.A.	725,932	2018/11/27	EUR	625,633	15,652	–	15,652
USD	Citibank N.A.	175,533	2018/11/27	GBP	132,692	5,799	–	5,799
USD	Citibank N.A.	539,430	2018/11/27	HKD	4,224,079	101	–	101
						$ 23,437	$ –	$ 23,437

通貨の略称：

AUD	-	オーストラリア・ドル
BRL	-	ブラジル・レアル
CHF	-	スイス・フラン
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
HKD	-	香港ドル
IDR	-	インドネシア・ルピア
INR	-	インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
NOK	-	ノルウェー・クローネ
RUB	-	ロシア・ルーブル
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル

「ダイワ・マネーストック・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

	2019年11月21日現在	2020年5月21日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	101,923,032,422	78,965,228,295
流動資産合計	101,923,032,422	78,965,228,295
資産合計	101,923,032,422	78,965,228,295
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	442,764	228,408
流動負債合計	442,764	228,408
負債合計	442,764	228,408
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	101,767,505,095	78,862,474,039
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	155,084,563	102,525,848
元本等合計	101,922,589,658	78,964,999,887
純資産合計	101,922,589,658	78,964,999,887
負債純資産合計	101,923,032,422	78,965,228,295

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年11月21日現在	2020年5月21日現在
1.　※1　期首	2019年5月22日	2019年11月22日
期首元本額	64,633,721,434円	101,767,505,095円
期中追加設定元本額	103,726,179,415円	57,934,625,352円
期中一部解約元本額	66,592,395,754円	80,839,656,408円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ロボット・テクノロジー関連	947,268円	947,268円
株ファンド －ロボテック－		

ダイワ／ミレーアセット・インド株式ファンド －インドの匠－	29,910,270円	29,910,270円	
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジあり）	998円	998円	
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジなし）	998円	998円	
新興国ソブリン・豪ドルファンド（毎月決算型）	999円	999円	
新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド（毎月決算型）	999円	999円	
新興国ソブリン・ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	999円	999円	
ＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	102,434円	102,434円	
ＵＳ短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	1,994円	－円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド －ロボテック－（為替ヘッジあり）	39,849円	39,849円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－（為替ヘッジあり）	3,985円	3,985円	
iFreeレバレッジ S&P500	995,814円	600,166,963円	
iFreeレバレッジ NASDAQ100	29,943,109円	2,516,612,585円	
米国4資産リスク分散ファンド（年2回決算型）	664,937円	669,933円	
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	3,367,020,967円	4,375,637,865円	
ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	6,533,595,057円	6,783,165,780円	
ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ（2倍）指数	1,055,005,531円	945,182,254円	
ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース（-2倍）指数	1,116,508,020円	2,314,863,282円	
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	46,620,451,844円	8,675,521,828円	

	ダイワ上場投信－TOPIXインバース（-1倍）指数	10,870,537,799円	11,170,317,850円
	ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400レバレッジ・インデックス	393,430,558円	283,592,322円
	ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400インバース・インデックス	811,328,174円	1,011,018,651円
	ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400ダブルインバース・インデックス	441,671,679円	1,120,727,988円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-07	997円	997円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-07	997円	997円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2017-06	997円	997円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2017-06	997円	－円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-10	997円	997円
	ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-10	997円	－円
	先進国トータルリターン戦略ファンド（リスク抑制型／適格機関投資家専用）	5,290,885,729円	6,988,339,549円
	ダイワ日本株式ベア・ファンド（適格機関投資家専用）	10,596,789,950円	17,676,300,505円
	低リスク型アロケーションファンド（金利トレンド判断付き／適格機関投資家専用）	179,433,743円	179,433,743円
	ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ －SLトレード－	83,063,391円	108,293,352円

ダイワ／モルガン・スタンレー新興４カ国不動産関連ファンド－成長の槌音（つちおと）－	5,020,480円	－円
ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	335,714,546円	77,340,066円
ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ	8,383,335円	8,332,691円
低リスク型アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	13,958,125,625円	13,958,125,625円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース（毎月分配型）	595,106円	595,106円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）	987,373円	987,373円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース（毎月分配型）	494,581円	494,581円
ダイワＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	9,957円	9,957円
ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）	997円	997円

ダイワ／ミレーアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円	9,958,176円	
＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα　為替ヘッジあり	49,806円	－円	
＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα　為替ヘッジなし	49,806円	－円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース	1,989,053円	1,989,053円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース	2,978,118円	2,978,118円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース	1,691,241円	1,691,241円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－	100,588円	100,588円	
ダイワ先進国リートα　為替ヘッジあり（毎月分配型）	399,083円	399,083円	
ダイワ先進国リートα　為替ヘッジなし（毎月分配型）	99,771円	99,771円	
通貨選択型ダイワ先進国リートα　円ヘッジコース（毎月分配型）	399,083円	399,083円	
通貨選択型ダイワ先進国リートα　通貨セレクトコース（毎月分配型）	99,771円	99,771円	
ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）	1,091,429円	1,091,429円	
ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジなし）	315,004円	315,004円	

ダイワ／ミレーアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	10,009,811円	10,009,811円	
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－日本円・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円	
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－豪ドル・コース（毎月分配型）	99,691円	99,691円	
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円	
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－米ドル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円	
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－通貨セレクト・コース（毎月分配型）	1,993,820円	1,993,820円	
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　日本円・コース	300,273円	300,273円	
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　豪ドル・コース	200,861円	200,861円	
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　ブラジル･レアル・コース	300,273円	300,273円	

通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド －イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 米ドル・コース	1,999,177円	1,999,177円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド －イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース	505,900円	505,900円
計	101,767,505,095円	78,862,474,039円
2. 期末日における受益権の総数	101,767,505,095口	78,862,474,039口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年11月22日 至　2020年5月21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、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、信用リスクであります。
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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年5月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

2019年11月21日現在	2020年5月21日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年11月21日現在	2020年5月21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）

	2019年11月21日現在	2020年5月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0015円 (10,015円)	1.0013円 (10,013円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・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か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2019年11月22日から2020年5月21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】

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,966,057	16,512,860
投資信託受益証券	1,037,253,037	554,801,038
親投資信託受益証券	2,982,585	2,981,989
流動資産合計	1,067,201,679	574,295,887
資産合計	1,067,201,679	574,295,887
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,572,065	8,834,217
未払解約金	504	1,884,557
未払受託者報酬	30,490	15,359
未払委託者報酬	1,169,078	588,910
その他未払費用	50,550	35,239
流動負債合計	11,822,687	11,358,282
負債合計	11,822,687	11,358,282
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,114,413,179	※1 1,766,843,432
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 1,059,034,187	※2 △ 1,203,905,827
（分配準備積立金）	96,904,275	78,228,865
元本等合計	1,055,378,992	562,937,605
純資産合計	1,055,378,992	562,937,605
負債純資産合計	1,067,201,679	574,295,887

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
営業収益		
受取配当金	82,837,067	61,238,255
受取利息	32	60
有価証券売買等損益	△ 12,622,526	△ 358,690,850
営業収益合計	70,214,573	△ 297,452,535
営業費用		
支払利息	5,553	3,053
受託者報酬	199,561	141,091
委託者報酬	7,651,493	5,410,267
その他費用	50,743	35,253
営業費用合計	7,907,350	5,589,664
営業利益又は営業損失（△）	62,307,223	△ 303,042,199
経常利益又は経常損失（△）	62,307,223	△ 303,042,199
当期純利益又は当期純損失（△）	62,307,223	△ 303,042,199
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（△）	10,205,957	△ 3,328,514
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 1,385,020,223	△ 1,059,034,187
剰余金増加額又は欠損金減少額	359,955,057	226,973,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	359,955,057	226,973,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,657,315	13,945,540
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,657,315	13,945,540
分配金	※1 68,412,972	※1 58,185,415
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 1,059,034,187	△ 1,203,905,827

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1.　※1　期首元本額	2,809,395,091円	2,114,413,179円
期中追加設定元本額	37,245,943円	24,451,696円
期中一部解約元本額	732,227,855円	372,021,443円
2.　特定期間末日における受益権の総数	2,114,413,179口	1,766,843,432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1,059,034,187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1,203,905,827円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
※1　分配金の計算過程	（自2019年5月22日　至2019年6月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,844,114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（22,848,612円）及び分配準備積立金（107,009,881円）より分配対象額は144,702,607円（1万口当たり590.10円）であり、うち12,260,763円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2019年11月22日　至2019年12月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,434,026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（20,602,812円）及び分配準備積立金（94,066,154円）より分配対象額は127,102,992円（1万口当たり618.08円）であり、うち10,282,005円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

		（自2019年6月22日　至2019年7月22日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,202,983円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（22,702,236円）及び分配準備積立金（105,275,388円）より分配対象額は142,180,607円（1万口当たり600.28円）であり、うち11,842,834円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2019年7月23日　至2019年8月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,342,657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（22,732,727円）及び分配準備積立金（106,703,374円）より分配対象額は142,778,758円（1万口当たり607.01円）であり、うち11,760,891円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2019年12月24日　至2020年1月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,772,473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（20,592,013円）及び分配準備積立金（95,293,469円）より分配対象額は125,657,955円（1万口当たり615.99円）であり、うち10,199,644円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2020年1月22日　至2020年2月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,876,869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（20,641,430円）及び分配準備積立金（94,233,827円）より分配対象額は124,752,126円（1万口当たり614.66円）であり、うち10,148,094円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

		（自2019年8月22日　至2019年9月24日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,785,962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（21,846,884円）及び分配準備積立金（102,835,048円）より分配対象額は136,467,894円（1万口当たり609.66円）であり、うち11,192,106円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2019年9月25日　至2019年10月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,463,055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（21,237,989円）及び分配準備積立金（99,473,334円）より分配対象額は131,174,378円（1万口当たり608.17円）であり、うち10,784,313円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2020年2月22日　至2020年3月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,163,564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（20,228,199円）及び分配準備積立金（91,205,069円）より分配対象額は120,596,832円（1万口当たり611.10円）であり、うち9,867,269円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2020年3月24日　至2020年4月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（8,332,130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（18,398,605円）及び分配準備積立金（80,962,693円）より分配対象額は107,693,428円（1万口当たり608.15円）であり、うち8,854,186円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

	（自2019年10月22日　至2019年11月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,454,432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（20,998,836円）及び分配準備積立金（97,021,908円）より分配対象額は128,475,176円（1万口当たり607.62円）であり、うち10,572,065円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2020年4月22日　至2020年5月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,025,884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（18,579,253円）及び分配準備積立金（80,037,198円）より分配対象額は105,642,335円（1万口当たり597.92円）であり、うち8,834,217円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2020年5月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2019年11月21日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当　期 2020年5月21日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	11,205,340	△28,936,420
親投資信託受益証券	△297	0
合計	11,205,043	△28,936,420

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4991円 (4,991円)	0.3186円 (3,186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	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND BRL CLASS	18,775,628.240	554,801,038	
投資信託受益証券　合計			554,801,038	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	2,978,118	2,981,989	
親投資信託受益証券　合計			2,981,989	
合計			557,783,027	

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－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・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・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」の状況

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」に記載のとおりであります。

【通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・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か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2019年11月22日から2020年5月21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】

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,702,131	8,901,837
投資信託受益証券	426,708,525	303,187,775
親投資信託受益証券	1,693,777	1,693,439
未収入金	28,000,000	―
流動資産合計	468,104,433	313,783,051
資産合計	468,104,433	313,783,051
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,382,090	5,952,530
未払解約金	29,548,555	―
未払受託者報酬	12,930	8,149
未払委託者報酬	495,861	312,571
その他未払費用	19,068	15,213
流動負債合計	36,458,504	6,288,463
負債合計	36,458,504	6,288,463
純資産の部		
元本等		
元本	※1 911,727,203	※1 850,361,487
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 480,081,274	※2 △ 542,866,899
（分配準備積立金）	30,054,708	22,534,841
元本等合計	431,645,929	307,494,588
純資産合計	431,645,929	307,494,588
負債純資産合計	468,104,433	313,783,051

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
営業収益		
受取配当金	41,743,433	33,208,039
受取利息	8	23
有価証券売買等損益	4,444,169	△ 92,729,127
営業収益合計	46,187,610	△ 59,521,065
営業費用		
支払利息	1,831	969
受託者報酬	75,544	61,155
委託者報酬	2,897,391	2,345,707
その他費用	19,146	15,217
営業費用合計	2,993,912	2,423,048
営業利益又は営業損失（△）	43,193,698	△ 61,944,113
経常利益又は経常損失（△）	43,193,698	△ 61,944,113
当期純利益又は当期純損失（△）	43,193,698	△ 61,944,113
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,240,115	813,558
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 519,317,771	△ 480,081,274
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,286,411	51,015,261
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	48,286,411	51,015,261
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,329,676	14,500,662
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,329,676	14,500,662
分配金	※1 40,673,821	※1 36,542,553
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 480,081,274	△ 542,866,899

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1.　※1　期首元本額	982,179,868円	911,727,203円
期中追加設定元本額	19,498,300円	24,342,871円
期中一部解約元本額	89,950,965円	85,708,587円
2.　特定期間末日における受益権の総数	911,727,203口	850,361,487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480,081,274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542,866,899円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2019年5月22日 至　2019年11月21日	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
※1　分配金の計算過程	（自2019年5月22日　至2019年6月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,366,401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（3,222,844円）及び分配準備積立金（33,931,735円）より分配対象額は44,520,980円（1万口当たり456.85円）であり、うち6,821,713円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自2019年11月22日　至2019年12月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,854,799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（3,603,965円）及び分配準備積立金（28,761,379円）より分配対象額は38,220,143円（1万口当たり436.27円）であり、うち6,132,430円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

		（自2019年6月22日　至2019年7月22日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,128,813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（3,294,422円）及び分配準備積立金（34,473,529円）より分配対象額は44,896,764円（1万口当たり459.88円）であり、うち6,833,926円（1万口当たり70円）を分配金額としております。 （自2019年7月23日　至2019年8月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,000,517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（3,506,685円）及び分配準備積立金（34,768,381円）より分配対象額は45,275,583円（1万口当たり461.19円）であり、うち6,871,999円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自2019年12月24日　至2020年1月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,426,772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（3,645,462円）及び分配準備積立金（28,450,401円）より分配対象額は37,522,635円（1万口当たり428.21円）であり、うち6,133,937円（1万口当たり70円）を分配金額としております。 （自2020年1月22日　至2020年2月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,894,081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（3,819,275円）及び分配準備積立金（27,651,396円）より分配対象額は36,364,752円（1万口当たり414.12円）であり、うち6,146,870円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	

		（自2019年8月22日　至2019年9月24日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,671,019円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,663,711円）及び分配準備積立金（34,790,531円）より分配対象額は45,125,261円（1万口当たり459.11円）であり、うち6,880,252円（1万口当たり70円）を分配金額としております。 （自2019年9月25日　至2019年10月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,905,503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（3,789,402円）及び分配準備積立金（34,475,821円）より分配対象額は44,170,726円（1万口当たり449.16円）であり、うち6,883,841円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自2020年2月22日　至2020年3月23日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,794,053円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,061,137円）及び分配準備積立金（26,303,428円）より分配対象額は35,158,618円（1万口当たり398.81円）であり、うち6,171,128円（1万口当たり70円）を分配金額としております。 （自2020年3月24日　至2020年4月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,692,315円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,115,449円）及び分配準備積立金（24,104,596円）より分配対象額は33,912,360円（1万口当たり395.27円）であり、うち6,005,658円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	

	（自2019年10月22日　至2019年11月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,484,882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（3,626,492円）及び分配準備積立金（30,951,916円）より分配対象額は40,063,290円（1万口当たり439.42円）であり、うち6,382,090円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自2020年4月22日　至2020年5月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,972,697円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,146,083円）及び分配準備積立金（23,514,674円）より分配対象額は32,633,454円（1万口当たり383.76円）であり、うち5,952,530円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2020年5月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2019年11月21日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当　期 2020年5月21日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	10,848,090	13,977,745
親投資信託受益証券	△169	0
合計	10,847,921	13,977,745

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2019年11月22日 至　2020年5月21日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2019年11月21日現在	当　期 2020年5月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4734円 (4,734円)	0.3616円 (3,616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	MIRAE ASSET GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA FUND CURRENCY SELECT CLASS	8,733,121.390	303,187,775	
投資信託受益証券　合計			303,187,775	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	1,691,241	1,693,439	
親投資信託受益証券　合計			1,693,439	
合計			304,881,214	

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－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・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・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・プレミアム・トラスト－ミレーアセット・グローバル・ハイ・ディヴィデンド・エクイティ・アルファ・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の状況

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）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】

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース

【純資産額計算書】

2020年5月29日

Ⅰ	資産総額	452,559,367円
Ⅱ	負債総額	128,149円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	452,431,218円
Ⅳ	発行済数量	660,262,788口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6852円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

純資産額計算書

2020年5月29日

Ⅰ	資産総額	81,943,861,102円
Ⅱ	負債総額	130,228,408円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	81,813,632,694円
Ⅳ	発行済数量	81,708,732,149口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0013円

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース

純資産額計算書

2020年5月29日

Ⅰ	資産総額	597,651,649円
Ⅱ	負債総額	164,697円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	597,486,952円
Ⅳ	発行済数量	1,755,040,994口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.3404円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」の記載と同じ。

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース

純資産額計算書

2020年5月29日

Ⅰ	資産総額	319,760,887円
Ⅱ	負債総額	88,254円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	319,672,633円
Ⅳ	発行済数量	871,180,641口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.3669円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース」の記載と同じ。

第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部　【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】

ａ．資本金の額

2020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

①　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。

②　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．商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ．商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

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．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

・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。

2020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	53	90,131
追加型株式投資信託	694	16,346,516
株式投資信託　　合計	747	16,436,647
単位型公社債投資信託	27	93,365
追加型公社債投資信託	14	1,424,426
公社債投資信託　合計	41	1,517,790
総合計	788	17,954,437

３　【委託会社等の経理状況】

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（2019年４月１日から2020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 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,489		2,741
有価証券		554		22,167
前払費用		214		205
未収委託者報酬		11,468		10,847
未収収益		98		63
その他		56		62
流動資産計		40,882		36,088
固定資産				
有形固定資産	※1	206	※1	217
建物		10		7
器具備品		195		209
無形固定資産		2,821		2,362
ソフトウェア		2,804		2,028
ソフトウェア仮勘定		17		333
投資その他の資産		12,799		15,844
投資有価証券		8,493		9,153
関係会社株式		1,836		3,972
出資金		183		183
長期差入保証金		1,070		1,069
繰延税金資産		1,183		1,431
その他		31		33
固定資産計		15,827		18,424

資産合計	56,709	54,512

（単位:百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	※2 3,882	※2 3,530
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
固定負債		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	△363
評価・換算差額等合計	46	△363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	△15	△78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年４月１日 至　2019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	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,669	△12,669	△12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△798	△798	△798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度（自　2019年４月１日 至　2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

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）子会社株式及び関連会社株式
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　　８～18年

器具備品　　４～17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。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（未適用の会計基準等）

１．収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年３月30日）

・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年３月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

２．時価の算定に関する会計基準等
・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日）
・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年７月４日）
・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）

(1) 概要
国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（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「受取配当金」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172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

※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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
未払金	3,788百万円	3,397百万円

３　保証債務

前事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万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　2018年４月１日　至　2019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
2018年６月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 ３月31日	2018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

2019年６月21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。

① 剰余金の配当の総額　11,868百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,550円
④ 基準日　2019年３月31日
⑤ 効力発生日　2019年６月24日

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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
2019年６月21日定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年３月31日	2019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

2020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。

① 剰余金の配当の総額　10,564百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,050円
④ 基準日　2020年３月31日
⑤ 効力発生日　2020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、子会社株式並びに関連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、子会社株式及び関連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代行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関係す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

①市場リスクの管理

（ｉ）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。

（ii）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。

②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（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,489	28,489	―
（２）未収委託者報酬	11,468	11,468	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,380	8,380	―
資産計	48,338	48,338	―
（１）未払手数料	(4,610)	(4,610)	―
（２）その他未払金	(3,882)	(3,882)	―
（３）未払費用（*2）	(2,805)	(2,805)	―
負債計	(11,298)	(11,298)	―

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 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（2020年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	2,741	2,741	―
（２）未収委託者報酬	10,847	10,847	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
有価証券	21,900	21,900	―
その他有価証券	8,754	8,754	―
資産計	44,243	44,243	―
（１）未払手数料	(3,988)	(3,988)	―
（２）その他未払金	(3,530)	(3,530)	―
（３）未払費用（*2）	(2,889)	(2,889)	―
負債計	(10,408)	(10,408)	―

（*1）負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
（*2）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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	666	666
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	1,836	3,972
（３）長期差入保証金	1,070	1,069

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（2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

当事業年度（2020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	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

（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（2019年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,836百万円）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（2020年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）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（2019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	87	55	32
（２）その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）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（2020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	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）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　2018年４月１日　至　2019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	389	86	-
（２）その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、証券投資信託について48百万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おります。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	△171	△183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

(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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

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174百万円、当事業年度181百万円であります。

（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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	731	788
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	△164	△173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△159
その他有価証券評価差額金	△85	△71
繰延税金負債合計	△244	△230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

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（2019年３月31日）

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。

当事業年度（2020年３月31日）
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。

（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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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　2018年４月１日　至　2019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）	1,719	－	－
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資（注２）	3,293	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

（注２）当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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）	1,603	－	－

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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

（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　2018年４月１日　至　2019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）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	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）	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱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）	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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）	1,063	長期差入保証金	1,055

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　2019年４月１日　至　2020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）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	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）	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱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）	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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）	1,061	長期差入保証金	1,054

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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）		当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	
１株当たり純資産額	15,389.06円	１株当たり純資産額	14,732.52円
１株当たり当期純利益	4,550.81円	１株当たり当期純利益	4,050.66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おりません。

(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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
当期純利益（百万円）	11,870	10,566
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】

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。

① 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。)。

② 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。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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。

④ 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。

⑤ 上記③④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

① 2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

② 2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

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】

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

①　名称　株式会社りそな銀行

②　資本金の額　279,928百万円（2020年3月末日現在）

③　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

①　名称　大和証券株式会社

②　資本金の額　100,000百万円（2020年3月末日現在）

③　事業の内容

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充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：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27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　【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2019年12月5日	臨時報告書
2020年2月14日	有価証券届出書、有価証券報告書
2020年3月9日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2020年５月22日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

監査意見

　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アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61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。

　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、大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全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。

監査意見の根拠

　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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

　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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。

独立監査人の監査報告書

2020年6月26日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之	印

監査意見

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」に掲げられている通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コースの2019年11月22日から2020年5月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コースの2020年5月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント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。

独立監査人の監査報告書

2020年6月26日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之	印

監査意見

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」に掲げられている通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コースの2019年11月22日から2020年5月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コースの2020年5月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント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。

独立監査人の監査報告書

2020年6月26日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之	印

監査意見

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」に掲げられている通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コースの2019年11月22日から2020年5月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コースの2020年5月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント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。