【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	平成29年8月24日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　岩本　信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村　政 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5695-2111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣダイワ外国株式インデックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成29年2月22日から平成30年2月21日まで） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

Ⅰ．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成29年2月21日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

Ⅱ．【訂正の内容】

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

第二部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１　【ファンドの性格】

(3) 【ファンドの仕組み】

＜更新後＞

＜略＞

＜委託会社の概況（平成29年6月末日現在）＞

＜略＞

２　【投資方針】

(3) 【運用体制】

＜更新後＞

＜略＞

※　上記の運用体制は平成29年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

３　【投資リスク】

＜更新後＞

＜略＞

参　考　情　報

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

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ 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。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― 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】

(5) 【課税上の取扱い】

＜更新後＞

＜略＞

（※）上記は、平成29年6月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

＜略＞

5 【運用状況】

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

＜訂正後＞

(1) 【投資状況】 (平成29年6月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		51,164,815,235	99.99
	内 日本	51,164,815,235	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,729,896	0.01
純資産総額		51,167,545,131	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】 (平成29年6月30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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,178,769,247	1.9616 45,469,380,621	2.2074 51,164,815,235	99.99

(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
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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5計算期間末 (平成19年11月30日)	7,587,065,245	7,587,065,245	2.0319	2.0319
第6計算期間末 (平成20年12月1日)	5,270,403,313	5,270,403,313	0.9890	0.9890
第7計算期間末 (平成21年11月30日)	8,839,950,875	8,839,950,875	1.2077	1.2077
第8計算期間末 (平成22年11月30日)	11,403,950,823	11,403,950,823	1.2491	1.2491
第9計算期間末 (平成23年11月30日)	12,596,103,939	12,596,103,939	1.1305	1.1305
第10計算期間末 (平成24年11月30日)	17,999,307,024	17,999,307,024	1.4214	1.4214
第11計算期間末 (平成25年12月2日)	28,678,654,588	28,678,654,588	2.2321	2.2321
第12計算期間末 (平成26年12月1日)	39,584,221,949	39,584,221,949	2.8440	2.8440
第13計算期間末 (平成27年11月30日)	42,007,587,846	42,007,587,846	2.9058	2.9058
平成28年6月末日	36,355,181,617	—	2.3835	—
7月末日	38,989,600,286	—	2.5335	—
8月末日	39,319,895,144	—	2.5254	—
9月末日	38,851,555,741	—	2.4646	—
10月末日	39,882,729,169	—	2.5146	—
第14計算期間末 (平成28年11月30日)	43,745,121,447	43,745,121,447	2.7467	2.7467
12月末日	46,393,221,734	—	2.9194	—
平成29年1月末日	46,131,835,896	—	2.9096	—
2月末日	47,377,881,671	—	2.9653	—
3月末日	48,618,588,927	—	2.9933	—
4月末日	48,761,663,472	—	3.0137	—
5月末日	49,605,233,811	—	3.0588	—
6月末日	51,167,545,131	—	3.1061	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

第14計算期間	0.0000
平成28年12月1日～ 平成29年5月31日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	7.0
第6計算期間	△51.3
第7計算期間	22.1
第8計算期間	3.4
第9計算期間	△9.5
第10計算期間	25.7
第11計算期間	57.0
第12計算期間	27.4
第13計算期間	2.2
第14計算期間	△5.5
平成28年12月1日～ 平成29年5月31日	11.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5計算期間	1,882,608,215	848,180,929
第6計算期間	2,441,097,087	846,105,718
第7計算期間	2,731,652,658	740,875,077
第8計算期間	2,955,535,750	1,145,799,738
第9計算期間	3,580,493,700	1,567,956,750
第10計算期間	3,221,497,125	1,700,693,930
第11計算期間	3,876,092,212	3,690,744,040
第12計算期間	5,259,355,606	4,189,232,442
第13計算期間	4,800,706,535	4,262,524,996
第14計算期間	3,914,988,140	2,445,246,007
平成28年12月1日～ 平成29年5月31日	2,530,576,601	2,239,533,083

（参考）マザーファンド
外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成29年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		84,253,499,065	95.92
	内 香港	1,208,636,977	1.38
	内 シンガポール	432,335,478	0.49
	内 イスラエル	242,466,206	0.28
	内 ノルウェー	215,257,989	0.25

	内 スウェーデン	1,039,502,601	1.18
	内 デンマーク	635,851,444	0.72
	内 イギリス	6,250,569,422	7.12
	内 アイルランド	156,848,056	0.18
	内 オランダ	1,258,697,789	1.43
	内 ベルギー	405,582,461	0.46
	内 フランス	3,652,827,970	4.16
	内 ドイツ	3,415,173,698	3.89
	内 スイス	3,042,545,513	3.46
	内 ポルトガル	50,949,240	0.06
	内 スペイン	1,241,759,814	1.41
	内 イタリア	824,357,974	0.94
	内 フィンランド	363,191,722	0.41
	内 オーストリア	81,161,358	0.09
	内 カナダ	3,353,114,377	3.82
	内 アメリカ	53,959,805,177	61.43
	内 オーストラリア	2,360,891,639	2.69
	内 ニュージーランド	61,972,160	0.07
投資証券		2,223,324,611	2.53
	内 香港	44,697,380	0.05
	内 シンガポール	36,711,462	0.04
	内 イギリス	87,270,265	0.10
	内 フランス	123,821,213	0.14
	内 カナダ	16,792,235	0.02
	内 アメリカ	1,712,417,261	1.95
	内 オーストラリア	201,614,795	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,357,893,165	1.55
純資産総額		87,834,716,841	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,287,440,000	1.47
	内 アメリカ	1,287,440,000	1.47
為替予約取引（買建）		162,342,000	0.18
	内 日本	162,342,000	0.18

(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。
(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
(注4) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成29年6月30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	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	121,200	12,524.96 1,518,037,472	16,092.16 1,950,369,792	2.22
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,650	6,850.92 1,148,561,176	7,670.88 1,286,023,032	1.46
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	9,190	85,703.85 787,618,928	109,304.16 1,004,505,230	1.14
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,950	12,622.96 781,994,248	14,855.68 920,309,376	1.05
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	53,250	13,602.96 724,361,120	16,916.48 900,802,560	1.03
6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	94,305	9,613.74 906,625,126	9,038.40 852,366,312	0.97
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,470	8,858.52 721,706,899	10,208.80 831,710,936	0.95
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,057	86,511.48 610,512,179	102,792.48 725,406,531	0.83
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,400	8,011.11 580,007,500	9,792.06 708,945,796	0.81
10	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,740	88,607.23 597,213,102	105,035.84 707,941,562	0.81
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,472	5,813.24 630,576,007	6,247.36 677,663,634	0.77
12	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	230,601	2,272.48 524,036,160	2,723.84 628,120,228	0.72
13	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財･サービス	201,500	3,477.60 700,736,400	3,026.24 609,787,360	0.69
14	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	139,491	4,425.12 617,278,332	4,213.44 587,736,959	0.67
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	58,117	9,299.36 540,453,215	9,742.88 566,226,957	0.64
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	27,850	17,695.10 492,809,453	18,961.60 528,080,560	0.60
17	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	137,663	3,579.18 492,724,228	3,766.56 518,515,949	0.59
18	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	42,968	12,251.45 526,423,735	11,661.44 501,068,754	0.57
19	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,850	8,220.18 426,218,996	9,417.47 488,296,182	0.56
20	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	64,623	6,218.24 401,841,324	7,501.76 484,786,236	0.55
21	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	460,000	921.68 424,028,416	1,043.12 479,838,627	0.55
22	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,350	26,533.40 433,821,974	28,902.11 472,549,564	0.54

23	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	108,540	3,929.63 426,528,458	4,353.44 472,522,378	0.54
24	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	27,550	14,517.44 399,955,472	17,041.92 469,504,896	0.53
25	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	93,450	4,609.58 430,769,192	5,020.96 469,208,712	0.53
26	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	35,250	10,191.66 359,256,318	13,112.96 462,231,840	0.53
27	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	92,704	5,703.26 528,719,300	4,973.92 461,102,280	0.52
28	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	21,876	17,672.59 386,605,698	20,750.24 453,932,250	0.52
29	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,971	6,966.06 438,666,647	7,206.08 453,774,064	0.52
30	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	42,550	8,864.80 377,197,240	10,575.04 449,967,952	0.51

(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
株式	95.92%
投資証券	2.53%
合計	98.45%

(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

業種	投資比率
エネルギー	6.40%
素材	4.67%
資本財・サービス	10.47%
一般消費財・サービス	11.39%
生活必需品	9.72%
ヘルスケア	12.91%
金融	18.24%
情報技術	15.62%
電気通信サービス	2.66%
公益事業	3.24%
不動産	0.59%
その他	0.00%
合計	95.92%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率

株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2017年9月	買建	19	1,292,116,504	1,287,440,000	1.47%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2017年7月	買建	1,450,000	162,651,875	162,342,000	0.18%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

次へ

（参考情報）運用実績

2017年6月30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	31,061円
純資産総額	511億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	3.8%
6カ月間	6.4%
1年間	30.3%
3年間	28.9%
5年間	152.1%
設定来	210.6%

※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運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第3期 05年11月	第4期 06年11月	第5期 07年11月	第6期 08年12月	第7期 09年11月	第8期 10年11月	第9期 11年11月	第10期 12年11月	第11期 13年12月	第12期 14年12月	第13期 15年11月	第14期 16年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,264	97.4%
外国リート	65	2.5%
コール・ローン、その他		1.6%
合計	1,329	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	64.8%
イギリス	7.2%
その他	27.9%
合計	99.9%

通貨別構成	比率
米ドル	65.1%
ユーロ	13.1%
英ポンド	7.3%
カナダ・ドル	3.9%
スイス・フラン	3.5%
豪ドル	2.9%
香港ドル	1.3%
スウェーデン・クローネ	1.2%
デンマーク・クローネ	0.7%
その他	1.0%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
金融	18.2%
情報技術	15.6%
ヘルスケア	12.9%
一般消費財・サービス	11.4%
資本財・サービス	10.5%
生活必需品	9.7%
エネルギー	6.4%
素材	4.7%
公益事業	3.2%
電気通信サービス、他	3.3%
合計	95.9%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	2.2%
S&P500 201709	アメリカ	1.5%
MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
AMAZON.COM INC	アメリカ	1.1%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.0%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.0%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.8%
NESTLE SA-REG	スイス	0.8%
合計		11.9%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準（GICS）によるものです。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）です。

・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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2017年は6月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年12月1日から平成29年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ＤＣダイワ外国株式インデックス

ＤＣダイワ外国株式インデックス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 平成29年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	83,707,111
親投資信託受益証券	49,602,970,438
流動資産合計	49,686,677,549
資産合計	49,686,677,549
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,500,285
未払受託者報酬	10,218,710
未払委託者報酬	53,648,403
その他未払費用	1,076,340
流動負債合計	81,443,738
負債合計	81,443,738
純資産の部	
元本等	
元本	※1 16,217,270,915
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	33,387,962,896
（分配準備積立金）	8,579,377,863
元本等合計	49,605,233,811
純資産合計	49,605,233,811
負債純資産合計	49,686,677,549

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　平成28年12月1日 至　平成29年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	5,059,569,370
営業収益合計	5,059,569,370
営業費用	
支払利息	33,604
受託者報酬	10,218,710
委託者報酬	53,648,403
その他費用	1,076,725
営業費用合計	64,977,442
営業利益又は営業損失（△）	4,994,591,928
経常利益又は経常損失（△）	4,994,591,928
中間純利益又は中間純損失（△）	4,994,591,928
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	438,312,574
期首剰余金又は期首欠損金（△）	27,818,894,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,952,453,292
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,952,453,292
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,939,663,800
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,939,663,800
中間剰余金又は中間欠損金（△）	33,387,962,896

(3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　平成28年12月1日 至　平成29年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	当中間計算期間末 平成29年5月31日現在
1．※1　期首元本額	15,926,227,397円
期中追加設定元本額	2,530,576,601円
期中一部解約元本額	2,239,533,083円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	16,217,270,915口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自　平成28年12月1日 至　平成29年5月31日
	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	当中間計算期間末 平成29年5月31日現在
1．金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(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。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成29年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成29年5月31日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.0588円 (30,588円)

（参考）

当ファンドは、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの中間計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年5月31日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	214,163,572
コール・ローン	405,506,207
株式	82,879,830,352
投資証券	2,186,745,999
派生商品評価勘定	21,695,454
未収入金	1,690,759

未収配当金	202,367,722
差入委託証拠金	599,151,433
流動資産合計	86,511,151,498
資産合計	86,511,151,498
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,523,916
未払解約金	95,396,000
その他未払費用	84
流動負債合計	96,920,000
負債合計	96,920,000
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	39,761,842,448
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	46,652,389,050
元本等合計	86,414,231,498
純資産合計	86,414,231,498
負債純資産合計	86,511,151,498

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　平成28年12月1日 至　平成29年5月31日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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)投資証券 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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成29年5月31日現在
1. ※1　期首	平成28年12月1日
期首元本額	40,539,431,105円
期中追加設定元本額	2,937,835,920円
期中一部解約元本額	3,715,424,577円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	609,978,448円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	24,037,334円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	336,822,528円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	38,051,568円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,201,311,580円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	288,858,519円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	756,480,382円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	111,657,887円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	1,049,204円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	172,046円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス	316,955,589円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	178,522,760円

ＤＣダイワ外国株式インデックス	22,823,802,714円
ダイワ・ライフ・バランス３０	512,707,216円
ダイワ・ライフ・バランス５０	685,632,877円
ダイワ・ライフ・バランス７０	528,933,732円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,459,542,849円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	6,562,361円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	15,924,563円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,467,707円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	89,936円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	178,417円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	4,733,242円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	44,098,955円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	1,369,842,523円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	450,332,959円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,234,732,965円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	203,554,294円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	432,497,724円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	25,273,263円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	470,413円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,946,665,792円

ダイワライフスタイル２５	21,249,595円
ダイワライフスタイル５０	71,214,083円
ダイワライフスタイル７５	56,436,423円
計	39,761,842,448円
2. 期末日における受益権の総数	39,761,842,448口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成29年5月31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)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種　類	平成29年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
株価指数先物取引				
買　建	1,382,908,350	－	1,404,329,178	21,420,828
合計	1,382,908,350	－	1,404,329,178	21,420,828

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	平成29年5月31日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買　建	389,469,290	－	388,220,000	△1,249,290
アメリカ・ドル	389,469,290	－	388,220,000	△1,249,290
合計	389,469,290	－	388,220,000	△1,249,290

（注）1．時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成29年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.1733円
（1万口当たり純資産額）	(21,733円)

２ 【ファンドの現況】

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

＜訂正後＞

【純資産額計算書】

平成29年6月30日

Ⅰ	**資産総額**	**51,228,990,168円**
Ⅱ	**負債総額**	**61,445,037円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**51,167,545,131円**
Ⅳ	**発行済数量**	**16,473,343,672口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**3.1061円**

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成29年6月30日

Ⅰ	**資産総額**	**88,058,039,696円**
Ⅱ	**負債総額**	**223,322,855円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**87,834,716,841円**
Ⅳ	**発行済数量**	**39,791,364,480口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**2.2074円**

第三部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

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

＜訂正後＞

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

平成29年6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．ファンド個別会議

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

ロ．投資環境検討会

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年6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	76	204,058
追加型株式投資信託	688	13,744,103
株式投資信託　　合計	764	13,948,161
単位型公社債投資信託	18	105,139
追加型公社債投資信託	14	2,151,126
公社債投資信託　合計	32	2,256,265
総合計	796	16,204,426

３　【委託会社等の経理状況】

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

＜訂正後＞

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（平成28年４月１日から平成29年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成28年３月31日）		当事業年度 （平成29年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,715		31,260
有価証券		1,137		110
前払費用		159		190
未収委託者報酬		9,896		10,453
未収収益		87		72
繰延税金資産		468		439
その他		83		34
流動資産計		43,547		42,560
固定資産				
有形固定資産	※1	243	※1	229
建物		18		15
器具備品		224		214
無形固定資産		2,706		2,650
ソフトウェア		2,385		2,323
ソフトウェア仮勘定		321		327
投資その他の資産		14,223		12,353
投資有価証券		7,872		5,920
関係会社株式		5,129		5,129
出資金		123		185

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

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成28年３月31日）		当事業年度 （平成29年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		61		79
未払金		8,789		9,466
未払収益分配金		5		7
未払償還金		63		59
未払手数料		4,330		4,453
その他未払金	※2	4,390	※2	4,946
未払費用		4,215		4,077
未払法人税等		1,155		980
未払消費税等		538		223
賞与引当金		937		945
その他		22		3
流動負債計		15,720		15,776
固定負債				
退職給付引当金		2,209		2,318
役員退職慰労引当金		93		151
繰延税金負債		1,410		-
その他		-		7
固定負債計		3,714		2,477
負債合計		19,435		18,254
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495
利益剰余金				

利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13
その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531

賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	△6	△1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,261	△13,261	△13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,728	△1,728	△1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△15	△15	△15
当期変動額合計	△15	△15	△1,743
当期末残高	264	264	39,540

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「有価証券償還益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

（追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針（企業会計基準適用指針第26号 平成28年３月28日）」を当期から適用しております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

※２　関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
未払金	4,320百万円	4,877百万円

３　保証債務

前事業年度（平成28年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成29年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成27年６月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 ３月31日	平成27年 ６月24日

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

平成28年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　13,262百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　5,084円
④ 基準日　平成28年３月31日
⑤ 効力発生日　平成28年６月24日

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年６月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 ３月31日	平成28年 ６月24日

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

平成29年６月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　11,532百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,421円
④ 基準日　平成29年３月31日
⑤ 効力発生日　平成29年６月27日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に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（平成28年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	31,715	31,715	－
（２）未収委託者報酬	9,896	9,896	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,987	7,987	－
資産計	49,599	49,599	－
（１）未払手数料	4,330	4,330	－
（２）その他未払金	4,390	4,390	－
（３）未払費用（*）	3,420	3,420	－
負債計	12,141	12,141	－

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

当事業年度（平成29年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	31,260	31,260	－
（２）未収委託者報酬	10,453	10,453	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	5,060	5,060	－
資産計	46,774	46,774	－
（１）未払手数料	4,453	4,453	－
（２）その他未払金	4,946	4,946	－
（３）未払費用（*）	3,409	3,409	－
負債計	12,809	12,809	－

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

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

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

（３）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度（平成28年３月31日）	当事業年度（平成29年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	1,021	970
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	5,129	5,129
（３）長期差入保証金	1,049	1,050

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

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

当事業年度（平成29年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成28年３月31日）

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

当事業年度（平成29年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（平成28年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	141	55	86
（２）その他			
証券投資信託	3,875	3,408	466

小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,970	4,119	△148
小計	3,970	4,119	△148
合計	7,987	7,583	404

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

当事業年度（平成29年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	122	55	67
（２）その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,829	1,926	△96
小計	1,829	1,926	△96
合計	5,060	4,679	381

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１） 株式	3	-	0
（２） その他			
証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	50	-	1
（２）その他			
証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	△120	△122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

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

	前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,209百万円	2,318百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318
退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
勤務費用	222百万円	202百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度173百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引（譲渡損）	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	△347	△ 201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△2,086	△639
その他有価証券評価差額金	△124	△146
繰延税金負債合計	△2,210	△786
繰延税金資産の純額	△941	470

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 （平成28年３月31日）	当事業年度 （平成29年３月31日）

法定実効税率	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.02%	
評価性引当額の増減額	△1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	△0.19%	
その他	△0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,749	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,685	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	593	未払費用	252

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	―	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	―	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	―	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	―	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
１株当たり純資産額　15,826.85円	１株当たり純資産額　15,158.25円
１株当たり当期純利益　5,084.10円	１株当たり当期純利益　4,421.51円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(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　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）	当事業年度 （自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日）
当期純利益（百万円）	13,262	11,533
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４　【利害関係人との取引制限】

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

＜訂正後＞

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

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

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２　【その他の関係法人の概況】

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

＜訂正後＞

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称　三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額　342,037百万円（平成29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	② 資本金の額 単位：百万円 （平成29年3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	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。
損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	3,000	
ＰＷＭ日本証券株式会社	3,000	
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	100,005	（注1）
株式会社鹿児島銀行	18,130	（注2）
信金中央金庫	690,998	（注3）
住友生命保険相互会社	639,000	（注4）
損害保険ジャパン日本興亜株式会社	70,000	（注1）
株式会社千葉銀行	145,069	（注2）
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	（注1）
日本生命保険相互会社	1,300,000	（注4）
富国生命保険相互会社	116,000	
株式会社北洋銀行	121,101	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
株式会社三井住友銀行	1,770,996	
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注5）
株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行	1,711,958	（注2）
明治安田生命保険相互会社	830,000	（注4）
株式会社りそな銀行	279,928	（注5）

(注1) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注3) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注4) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注5）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 【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：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成29年3月末日現在）

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

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

第３　【その他】

＜更新後＞

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

＜略＞

⑫　委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

＜略＞

独立監査人の中間監査報告書

平成29年7月7日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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

　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ外国株式インデックスの平成28年12月1日から平成29年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
　当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
　中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
　当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
　当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣダイワ外国株式インデックスの平成29年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月1日から平成29年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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

(注) 2．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成29年５月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年４月１日から平成29年３月31日までの第58期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成29年３月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。