

【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27年9月11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 白川 真

【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】 山部 努
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3111

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** DCダイワ・ターゲットイヤー2030

**【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27年3月12日から平成28年3月11日まで）
10兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年3月11日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部 _____ は訂正部分を示します。 ）

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

< 2014年12月時点の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31%	16%	7%	7%	22%	17%

< 当初設定時の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

< 略 >

(注1) 2014年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2013年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

〈2015年7月時点の基本配分比率〉

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	29%	16%	6%	6%	24%	19%

〈当初設定時の基本配分比率〉

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

< 略 >

（注1）2015年7月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2014年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成26年12月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成27年7月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

< 略 >

上記の運用体制は平成27年1月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

< 略 >

上記の運用体制は平成27年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

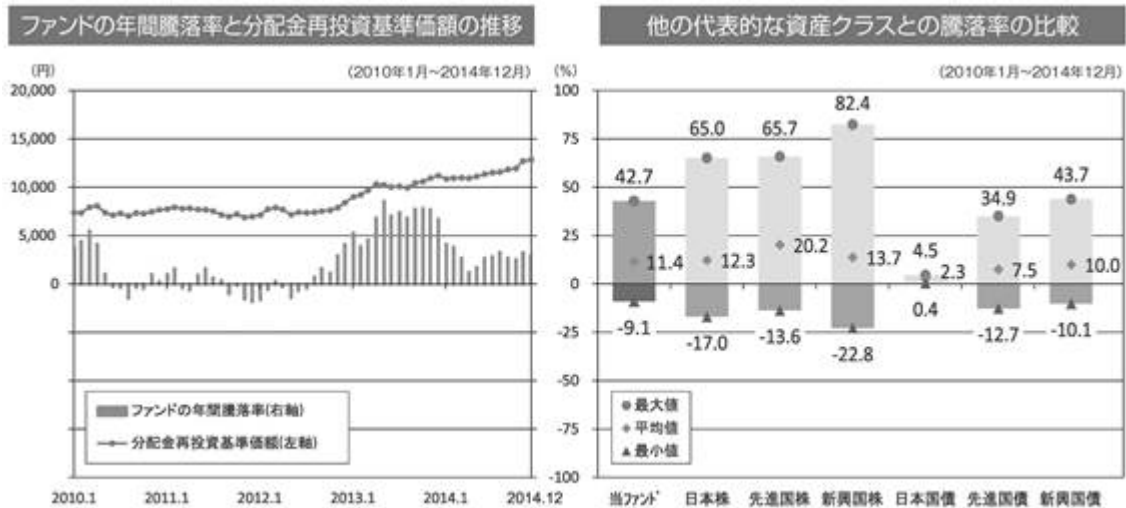
3 【投資リスク】

< 訂正前 >

< 略 >

参考情報

< 略 >



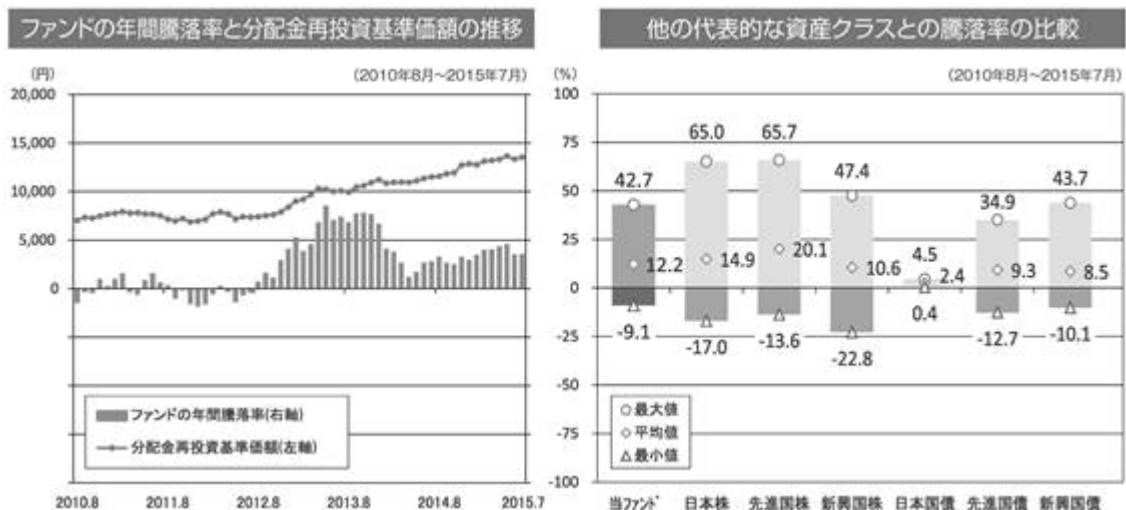
< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

参考情報

< 略 >



< 略 >

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

八．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、上場株式等の譲渡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との損益通算も可能となります。また、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。

< 略 >

() 上記は、平成26年12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 >

< 訂正後 >

< 略 >

八．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、上場株式等の譲渡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との損益通算も可能となります。また、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との相殺が可能となります。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

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。

< 略 >

() 上記は、平成27年7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27年7月31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	152,931,202	99.81
内 日本	152,931,202	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	294,978	0.19
純資産総額	153,226,180	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27年7月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	45,321,349	0.8232 37,308,900	0.9799 44,410,389	28.98
2	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	30,138,573	1.2136 36,578,116	1.2132 36,564,116	23.86
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,039,260	2.9020 29,134,470	2.9067 29,181,117	19.04
4	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	11,434,465	1.9582 22,391,861	2.1370 24,435,451	15.95
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,000,576	2.3354 9,343,013	2.2983 9,194,523	6.00
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,209,134	2.1048 8,859,592	2.1728 9,145,606	5.97

(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	99.81%
合計	99.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	2,735,746	2,735,746	0.6530	0.6530
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	7,830,771	7,830,771	0.7362	0.7362
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	19,887,419	19,887,419	0.7670	0.7670
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	22,353,895	22,353,895	0.6876	0.6876
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	43,076,218	43,076,218	0.8120	0.8120
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	73,041,242	73,041,242	1.0850	1.0850
平成26年7月末日	93,339,783	-	1.1508	-
8月末日	96,325,749	-	1.1570	-
9月末日	99,600,986	-	1.1841	-
10月末日	102,219,913	-	1.1943	-
11月末日	109,866,260	-	1.2711	-
第7計算期間末 (平成26年12月18日)	113,864,260	113,864,260	1.2566	1.2566
12月末日	117,396,539	-	1.2857	-
平成27年1月末日	119,153,842	-	1.2753	-
2月末日	133,780,801	-	1.3136	-
3月末日	142,903,299	-	1.3204	-
4月末日	145,227,528	-	1.3325	-
5月末日	153,224,391	-	1.3661	-
6月末日	148,572,003	-	1.3354	-
7月末日	153,226,180	-	1.3546	-

【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
平成26年12月19日～ 平成27年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	34.7
第2計算期間	12.7
第3計算期間	4.2
第4計算期間	10.4
第5計算期間	18.1
第6計算期間	33.6
第7計算期間	15.8
平成26年12月19日～ 平成27年6月18日	7.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	8,866,423	5,677,066
第2計算期間	8,210,996	1,763,695
第3計算期間	15,967,619	676,450
第4計算期間	11,508,725	4,926,400
第5計算期間	25,323,485	4,786,754
第6計算期間	24,816,314	10,545,012
第7計算期間	30,371,983	7,076,122
平成26年12月19日～ 平成27年6月18日	29,727,083	8,879,375

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成27年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	138,503,810,420	99.55
内 日本	138,503,810,420	99.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	626,885,488	0.45
純資産総額	139,130,695,908	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)	514,600,000	0.37
内 日本	514,600,000	0.37

(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。

(2) 投資資産（平成27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	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	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	783,400	6,494.00 5,087,399,600	8,253.00 6,465,400,200	4.65
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,498,700	628.45 2,827,237,960	900.00 4,048,830,000	2.91
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	423,700	4,463.00 1,890,973,100	5,544.00 2,348,992,800	1.69
4	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,811,900	200.44 1,565,880,984	267.90 2,092,808,010	1.50
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	438,800	3,418.00 1,499,818,400	4,763.50 2,090,223,800	1.50
6	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	297,000	8,686.17 2,579,793,412	6,881.00 2,043,657,000	1.47
7	本田技研	日本	株式	輸送用機器	510,100	3,756.00 1,915,935,600	3,979.50 2,029,942,950	1.46
8	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	376,600	3,684.95 1,387,753,207	4,813.50 1,812,764,100	1.30
9	KDDI	日本	株式	情報・通信業	570,600	2,221.03 1,267,320,403	3,150.50 1,797,675,300	1.29
10	ソニー	日本	株式	電気機器	398,400	2,040.74 813,034,793	3,533.00 1,407,547,200	1.01
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	222,400	4,893.50 1,088,314,400	6,240.00 1,387,776,000	1.00
12	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	233,700	4,115.00 961,675,500	5,724.00 1,337,698,800	0.96
13	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,800	8,109.00 841,714,200	12,250.00 1,271,550,000	0.91
14	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	665,400	1,600.50 1,064,972,700	1,867.00 1,242,301,800	0.89
15	ファナック	日本	株式	電気機器	59,200	19,320.00 1,143,744,000	20,680.00 1,224,256,000	0.88
16	キヤノン	日本	株式	電気機器	306,200	3,591.00 1,099,564,200	3,972.00 1,216,226,400	0.87
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	226,200	3,370.27 762,357,225	5,165.00 1,168,323,000	0.84
18	三菱商事	日本	株式	卸売業	426,900	2,312.50 987,206,250	2,679.50 1,143,878,550	0.82
19	三菱地所	日本	株式	不動産業	415,000	2,387.52 990,824,960	2,755.00 1,143,325,000	0.82

20	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	432,200	1,909.50 825,285,900	2,614.50 1,129,986,900	0.81
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	50,800	14,535.00 738,378,000	21,720.00 1,103,376,000	0.79
22	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,600	11,810.00 703,876,000	18,400.00 1,096,640,000	0.79
23	日立	日本	株式	電気機器	1,359,000	830.90 1,129,193,100	804.40 1,093,179,600	0.79
24	三井不動産	日本	株式	不動産業	296,000	3,350.50 991,748,000	3,528.50 1,044,436,000	0.75
25	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品 先物取引業	1,143,800	689.00 788,078,200	881.40 1,008,145,320	0.72
26	パナソニック	日本	株式	電気機器	691,000	1,317.39 910,321,033	1,457.00 1,006,787,000	0.72
27	花王	日本	株式	化学	159,700	4,245.50 678,006,350	6,291.00 1,004,672,700	0.72
28	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	796,800	1,076.50 857,755,200	1,198.50 954,964,800	0.69
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	200,900	3,746.36 752,643,963	4,678.00 939,810,200	0.68
30	第一生命	日本	株式	保険業	359,300	1,650.80 593,132,980	2,522.00 906,154,600	0.65

(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	99.55%
合計	99.55%

(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
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.38%
建設業	2.61%
食料品	4.50%
繊維製品	0.75%
パルプ・紙	0.24%
化学	5.90%
医薬品	4.95%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	1.27%
非鉄金属	0.92%
金属製品	0.56%
機械	4.57%
電気機器	11.79%
輸送用機器	10.99%
精密機器	1.43%
その他製品	1.61%

電気・ガス業	2.30%
陸運業	4.19%
海運業	0.27%
空運業	0.68%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	6.99%
卸売業	3.98%
小売業	4.86%
銀行業	9.67%
証券・商品先物取引業	1.42%
保険業	2.76%
その他金融業	1.34%
不動産業	2.82%
サービス業	3.19%
合計	99.55%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2015年9月	買建	31	501,524,572	514,600,000	0.37%

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成27年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		79,443,000,089	95.99
	内 香港	1,062,242,720	1.28
	内 シンガポール	459,130,396	0.55
	内 イスラエル	240,520,522	0.29
	内 ノルウェー	220,233,629	0.27
	内 スウェーデン	1,010,411,525	1.22
	内 デンマーク	598,152,321	0.72
	内 イギリス	6,970,906,244	8.42
	内 アイルランド	128,880,968	0.16
	内 オランダ	984,281,094	1.19

内 ベルギー	455,730,488	0.55
内 フランス	3,301,342,391	3.99
内 ドイツ	3,115,527,683	3.76
内 スイス	3,333,265,686	4.03
内 ポルトガル	49,167,089	0.06
内 スペイン	1,240,724,005	1.50
内 イタリア	859,350,774	1.04
内 フィンランド	303,221,077	0.37
内 オーストリア	62,064,017	0.07
内 カナダ	3,054,180,391	3.69
内 アメリカ	49,793,518,175	60.17
内 オーストラリア	2,164,221,919	2.62
内 ニュージーランド	35,926,975	0.04
投資証券	1,891,771,652	2.29
内 香港	35,600,400	0.04
内 シンガポール	22,198,344	0.03
内 イギリス	125,656,303	0.15
内 フランス	121,627,724	0.15
内 アメリカ	1,400,524,420	1.69
内 オーストラリア	186,164,461	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,425,543,934	1.72
純資産総額	82,760,315,675	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)	1,239,479,003	1.50
内 アメリカ	1,239,479,003	1.50

(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。

(2) 投資資産（平成27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	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	121,400	14,754.43 1,791,192,676	15,178.77 1,842,703,261	2.23
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	162,600	5,930.35 964,275,300	5,814.99 945,518,220	1.14
3	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	87,555	11,217.18 982,131,553	10,296.56 901,515,346	1.09

4	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	102,072	6,757.69 689,771,873	7,212.92 736,237,783	0.89
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	58,000	13,417.15 778,201,060	12,384.15 718,280,909	0.87
6	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	209,100	3,278.50 685,555,189	3,239.92 677,468,276	0.82
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	77,320	7,462.24 576,980,892	8,563.72 662,146,954	0.80
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	69,450	9,293.17 645,416,230	9,346.50 649,115,050	0.78
9	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	49,350	11,981.99 591,317,750	12,821.00 632,716,350	0.76
10	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	127,163	3,863.84 491,338,249	4,431.94 563,579,956	0.68
11	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	126,691	4,326.01 548,067,929	4,316.59 546,873,357	0.66
12	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	8,200	42,004.90 344,440,226	66,579.71 545,953,625	0.66
13	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	15,050	37,074.35 557,970,529	35,732.12 537,768,511	0.65
14	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	55,937	11,207.01 626,893,063	9,599.45 536,964,748	0.65
15	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	86,654	6,275.18 543,769,760	5,788.94 501,635,396	0.61
16	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	33,600	11,474.94 385,557,997	14,888.52 500,254,312	0.60
17	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,000	68,107.88 408,647,299	82,432.02 494,592,134	0.60
18	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	41,800	9,637.90 402,864,554	11,809.84 493,651,663	0.60
19	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	218,801	2,113.64 462,466,896	2,248.84 492,049,579	0.59
20	GOOGLE INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	6,217	67,185.76 417,693,933	78,466.46 487,826,004	0.59
21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	63,123	6,694.43 422,573,060	7,303.47 461,017,265	0.56
22	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	408,300	1,232.21 503,112,486	1,116.34 455,802,537	0.55
23	GILEAD SCIENCES INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	30,800	12,443.69 383,265,738	14,624.31 450,428,933	0.54
24	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	38,918	13,493.56 525,143,268	11,539.44 449,091,973	0.54
25	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,221	7,492.01 443,684,680	7,258.82 429,874,627	0.52
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	85,000	5,553.27 472,030,995	5,031.06 427,640,304	0.52
27	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	24,100	18,443.50 444,488,533	17,719.11 427,030,647	0.52
28	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	27,300	12,329.57 336,597,425	14,445.69 394,367,566	0.48

29	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	19,500	20,115.56 392,253,553	19,965.47 389,326,829	0.47
30	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	40,700	8,006.40 325,863,512	9,474.17 385,598,931	0.47

(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	95.99%
投資証券	2.29%
合計	98.28%

(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	7.34%
素材	4.61%
資本財・サービス	9.68%
一般消費財・サービス	12.10%
生活必需品	10.01%
ヘルスケア	14.08%
金融	18.58%
情報技術	13.38%
電気通信サービス	3.13%
公益事業	3.06%
合計	95.99%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2015年9月	買建	19	1,227,903,528	1,239,479,003	1.50%

(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。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (平成27年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	190,859,066,200	99.09

内 日本	190,859,066,200	99.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,752,063,536	0.91
純資産総額	192,611,129,736	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27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	25,814	589,926.21 15,228,355,245	554,000.00 14,300,956,000	7.42
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	23,937	581,883.99 13,928,557,215	556,000.00 13,308,972,000	6.91
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	44,428	238,399.45 10,591,610,898	243,000.00 10,796,004,000	5.61
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	48,343	186,940.03 9,037,242,336	180,000.00 8,701,740,000	4.52
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	31,641	254,444.80 8,050,888,081	244,500.00 7,736,224,500	4.02
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	40,873	167,216.11 6,834,624,226	168,800.00 6,899,362,400	3.58
7	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	23,766	281,711.36 6,695,152,351	270,500.00 6,428,703,000	3.34
8	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	15,960	408,405.17 6,518,146,590	401,500.00 6,407,940,000	3.33
9	森トラスト総合リート	日本	投資証券	24,132	247,250.19 5,966,641,721	230,300.00 5,557,599,600	2.89
10	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,848	667,503.14 5,906,067,838	612,000.00 5,414,976,000	2.81
11	API投資法人	日本	投資証券	5,066	1,021,211.76 5,173,458,826	1,042,000.00 5,278,772,000	2.74
12	GLP投資法人	日本	投資証券	43,707	120,831.73 5,281,192,429	119,300.00 5,214,245,100	2.71
13	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	9,068	534,640.37 4,848,118,956	540,000.00 4,896,720,000	2.54
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	57,411	80,523.21 4,622,918,424	80,200.00 4,604,362,200	2.39
15	NMF投資法人	日本	投資証券	30,444	145,056.92 4,416,113,000	148,900.00 4,533,111,600	2.35
16	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,402	644,473.39 4,770,392,057	574,000.00 4,248,748,000	2.21
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	28,703	162,910.92 4,676,032,229	145,300.00 4,170,545,900	2.17
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,858	438,816.33 3,887,035,116	440,500.00 3,901,949,000	2.03

19	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	57,929	58,762.05 3,404,026,962	66,000.00 3,823,314,000	1.98
20	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	6,811	577,108.17 3,930,683,756	530,000.00 3,609,830,000	1.87
21	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	13,670	252,713.55 3,454,594,250	261,500.00 3,574,705,000	1.86
22	産業ファンド	日本	投資証券	6,446	549,302.95 3,540,806,831	552,000.00 3,558,192,000	1.85
23	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	15,174	242,450.83 3,678,949,017	233,500.00 3,543,129,000	1.84
24	大和ハウスリート	日本	投資証券	6,411	513,253.14 3,290,465,897	489,000.00 3,134,979,000	1.63
25	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	23,031	149,866.78 3,451,582,033	135,800.00 3,127,609,800	1.62
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	4,815	650,129.86 3,130,375,308	649,000.00 3,124,935,000	1.62
27	イオンリート投資	日本	投資証券	19,931	168,339.29 3,355,170,419	149,000.00 2,969,719,000	1.54
28	福岡リート投資法人	日本	投資証券	13,657	215,928.87 2,948,940,711	208,500.00 2,847,484,500	1.48
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	17,872	152,138.98 2,719,027,907	143,200.00 2,559,270,400	1.33
30	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	29,983	86,785.71 2,602,095,974	82,100.00 2,461,604,300	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	99.09%
合計	99.09%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成27年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

投資証券		2,645,310,709	99.01
内 マン島		2,166,770	0.08
内 香港		45,688,160	1.71
内 シンガポール		85,972,856	3.22
内 イスラエル		1,097,462	0.04
内 イギリス		193,221,094	7.23
内 アイルランド		6,716,306	0.25
内 オランダ		14,970,210	0.56
内 ベルギー		14,296,191	0.54
内 フランス		130,582,169	4.89
内 ドイツ		4,425,347	0.17
内 スペイン		13,401,637	0.50
内 イタリア		2,904,222	0.11
内 カナダ		51,441,307	1.93
内 アメリカ		1,858,710,519	69.57
内 オーストラリア		208,108,823	7.79
内 ニュージーランド		11,607,636	0.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		26,318,906	0.99
純資産総額		2,671,629,615	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(%)
為替予約取引(買建)	5,724,995	0.21
内 日本	5,724,995	0.21

(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) 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27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	6,647	22,737.15 151,134,479	23,088.80 153,471,291	5.74
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	3,100	23,531.00 72,946,485	25,182.60 78,066,062	2.92
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	7,800	8,947.87 69,793,934	9,214.93 71,876,466	2.69
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	2,100	29,634.49 62,232,658	33,197.66 69,715,091	2.61
5	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	7,600	9,256.85 70,352,933	8,535.19 64,867,462	2.43

6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,800	20,217.89 56,610,181	21,239.36 59,470,234	2.23
7	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	7,079	9,047.60 64,048,184	8,231.29 58,269,333	2.18
8	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	11,246	5,268.97 59,255,084	4,986.40 56,077,144	2.10
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	3,300	16,302.94 53,799,832	15,299.09 50,487,009	1.89
10	HCP INC	アメリカ	投資証券	9,900	5,546.44 54,910,288	4,744.53 46,970,847	1.76
11	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	13,577	3,393.23 46,071,014	3,336.67 45,302,050	1.70
12	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	3,764	12,771.28 48,071,449	11,961.17 45,021,871	1.69
13	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	17,250	2,323.40 40,081,412	2,481.83 42,811,657	1.60
14	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	113,500	319.49 36,268,498	358.81 40,725,571	1.52
15	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	16,300	2,868.42 46,756,431	2,424.98 39,527,207	1.48
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,367	25,762.11 35,216,974	27,757.67 37,944,737	1.42
17	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	41,000	779.69 31,971,401	905.19 37,112,950	1.39
18	LINK REIT	香港	投資証券	50,000	793.21 39,661,593	719.20 35,960,000	1.35
19	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	22,000	1,503.60 33,080,480	1,604.58 35,300,866	1.32
20	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	2,100	14,683.23 30,835,054	14,166.60 29,749,878	1.11
21	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	5,017	5,875.03 29,475,032	5,905.54 29,628,116	1.11
22	MACERICH CO/THE	アメリカ	投資証券	3,000	9,998.36 29,995,316	9,685.04 29,055,130	1.09
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	8,800	3,189.19 28,065,129	3,032.77 26,688,446	1.00
24	KLEPIERRE	フランス	投資証券	4,600	5,276.87 24,273,820	5,675.70 26,108,255	0.98
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	1,500	16,657.08 24,985,625	16,938.90 25,408,354	0.95
26	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	2,900	8,659.35 25,112,171	8,017.94 23,252,042	0.87
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	5,600	3,876.12 21,706,975	4,145.41 23,214,334	0.87
28	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	2,400	7,455.17 17,892,522	9,033.83 21,681,200	0.81
29	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	16,750	1,218.09 20,403,190	1,267.03 21,222,786	0.79
30	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	19,508	1,163.49 22,699,647	1,066.74 20,810,042	0.78

(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
投資証券	99.01%
合計	99.01%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2015年8月	買建	26,500	3,597,450	3,597,375	0.13%
		英ポンド買/円売 2015年8月	買建	11,000	2,127,766	2,127,620	0.08%

(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) 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3) 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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（平成27年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	9,987,187,750	68.00
内 日本	9,987,187,750	68.00
地方債証券	1,768,006,997	12.04
内 日本	1,768,006,997	12.04
特殊債券	1,495,525,300	10.18
内 日本	1,495,525,300	10.18
社債券	1,329,153,736	9.05
内 日本	1,329,153,736	9.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	107,474,746	0.73
純資産総額	14,687,348,529	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27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	334 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.90 173,235,300	102.32 173,957,600	0.600000 2024/06/20	1.18
2	338 10年国債	日本	国債証券	165,000,000	100.35 165,593,970	100.13 165,229,350	0.400000 2025/03/20	1.12
3	333 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	101.97 163,157,040	102.43 163,897,600	0.600000 2024/03/20	1.12
4	116 5年国債	日本	国債証券	158,000,000	100.60 158,951,100	100.57 158,905,340	0.200000 2018/12/20	1.08
5	122 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.22 150,331,050	100.13 150,195,000	0.100000 2019/12/20	1.02
6	325 10年国債	日本	国債証券	142,000,000	104.12 147,858,920	104.32 148,144,340	0.800000 2022/09/20	1.01
7	335 10年国債	日本	国債証券	145,000,000	100.78 146,145,100	101.37 146,987,950	0.500000 2024/09/20	1.00
8	332 10年国債	日本	国債証券	135,000,000	102.20 137,971,440	102.53 138,422,250	0.600000 2023/12/20	0.94
9	319 10年国債	日本	国債証券	129,000,000	106.26 137,085,300	106.10 136,871,580	1.100000 2021/12/20	0.93
10	123 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.06 120,078,750	100.09 120,110,400	0.100000 2020/03/20	0.82
11	19 - 1 広島県公債	日本	地方債証券	110,800,000	104.27 115,535,370	103.07 114,208,097	1.780000 2017/05/25	0.78
12	307 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	106.38 111,699,620	105.62 110,902,050	1.300000 2020/03/20	0.76
13	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	105.36 108,527,760	104.90 108,050,090	1.100000 2020/06/20	0.74
14	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.09 107,097,200	106.12 106,123,000	1.570000 2019/11/25	0.72
15	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	106.58 106,588,000	105.87 105,875,000	1.300000 2020/06/20	0.72
16	5 日本政策投資CO	日本	特殊債券	100,000,000	106.92 106,927,000	105.79 105,799,800	1.745000 2019/03/20	0.72
17	21 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.50 106,508,700	105.52 105,528,900	1.570000 2019/05/27	0.72
18	324 10年国債	日本	国債証券	101,000,000	104.15 105,191,500	104.35 105,396,530	0.800000 2022/06/20	0.72
19	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	106.05 106,052,000	105.36 105,368,000	1.300000 2019/12/20	0.72
20	15 NTTドコモ	日本	社債券	100,000,000	106.49 106,498,000	105.30 105,301,000	1.960000 2018/06/20	0.72
21	98 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	105.57 105,570,000	105.24 105,243,800	1.300000 2020/01/31	0.72
22	76 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	105.90 105,909,200	105.05 105,057,600	1.400000 2019/07/25	0.72
23	70 東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	105.66 105,665,100	104.97 104,976,500	1.193000 2020/09/29	0.71

24	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	106.01 106,016,100	104.95 104,952,400	1.600000 2018/11/16	0.71
25	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	105.38 105,388,200	104.92 104,923,600	1.084000 2021/09/17	0.71
26	20 - 6 北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.00 106,005,400	104.85 104,851,000	1.720000 2018/08/29	0.71
27	30 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	105.88 105,885,500	104.62 104,625,200	1.870000 2018/03/20	0.71
28	660 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.83 104,836,000	104.27 104,273,400	1.580000 2018/06/20	0.71
29	28 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	105.22 105,222,200	103.98 103,988,100	1.890000 2017/10/25	0.71
30	20 - 1 千葉市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.49 104,495,000	103.97 103,971,100	1.550000 2018/04/25	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	68.00%
地方債証券	12.04%
特殊債券	10.18%
社債券	9.05%
合計	99.27%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (平成27年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	165,339,650,634	98.29
内 ユーロ	66,537,605,426	39.55
内 シンガポール	623,082,852	0.37
内 マレーシア	834,349,978	0.50
内 ノルウェー	466,612,393	0.28
内 スウェーデン	791,537,838	0.47

内 デンマーク	1,139,704,452	0.68
内 イギリス	14,286,968,703	8.49
内 スイス	448,064,806	0.27
内 ポーランド	941,308,565	0.56
内 カナダ	3,514,616,047	2.09
内 アメリカ	70,623,805,713	41.98
内 メキシコ	1,628,168,369	0.97
内 南アフリカ	853,711,898	0.51
内 オーストラリア	2,650,113,594	1.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,882,459,601	1.71
純資産総額	168,222,110,235	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(%)
為替予約取引（買建）	787,012,380	0.47
内 日本	787,012,380	0.47

(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) 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27年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,410,000	99.51 791,271,986	99.69 792,639,552	0.625000 2017/08/31	0.47
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,194,000	101.85 782,586,526	101.12 776,947,177	2.375000 2024/08/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,630,000	110.52 771,832,065	109.12 762,069,199	3.625000 2020/02/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,275,000	100.06 778,850,579	97.75 760,838,102	2.000000 2025/02/15	0.45
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	101.84 748,007,594	99.98 734,323,329	2.250000 2024/11/15	0.44
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,660,000	99.27 696,990,459	99.53 698,801,791	0.500000 2017/07/31	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	103.09 692,067,927	102.28 686,616,935	2.500000 2024/05/15	0.41
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	105.33 683,208,245	104.37 676,981,635	2.750000 2024/02/15	0.40
9	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,118,000	142.22 601,976,693	147.63 624,871,286	6.000000 2031/05/01	0.37
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,760,000	118.77 606,230,938	117.75 601,045,071	3.250000 2021/10/25	0.36

11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,635,000	106.10 610,024,595	104.33 599,871,413	3.250000 2017/03/31	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	105.08 587,736,579	104.50 584,464,696	2.625000 2020/11/15	0.35
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,468,000	103.46 573,386,410	102.69 569,146,698	2.500000 2023/08/15	0.34
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.62 567,325,624	97.28 565,373,036	1.750000 2023/05/15	0.34
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,590,000	117.15 570,941,232	115.88 564,747,109	3.500000 2020/04/25	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	164.05 558,327,395	165.24 562,353,443	5.750000 2032/10/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,502,000	101.10 564,598,710	100.63 561,957,345	1.000000 2016/08/31	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	110.97 561,080,273	109.84 555,351,972	3.625000 2021/02/15	0.33
19	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,854,000	100.69 555,887,096	100.57 555,224,603	1.250000 2018/07/22	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,480,000	117.81 556,570,590	117.02 552,814,182	3.000000 2022/04/25	0.33
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,123,000	129.94 550,877,056	128.82 546,133,086	4.250000 2023/10/25	0.32
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	153.20 545,534,733	152.94 544,598,263	5.500000 2029/04/25	0.32
23	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,722,000	143.73 531,128,439	145.92 539,209,656	6.500000 2027/11/01	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,020,000	109.03 543,673,050	107.84 537,749,197	3.375000 2019/11/15	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,325,000	99.07 531,485,478	100.10 537,036,296	1.500000 2019/11/30	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	124.84 533,153,563	125.12 534,374,982	3.500000 2026/04/25	0.32
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,737,000	100.56 532,410,173	100.41 531,616,005	1.000000 2017/09/07	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,149,000	104.51 537,898,630	103.00 530,096,658	2.750000 2016/11/30	0.32
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	121.14 531,187,510	119.76 525,123,435	3.750000 2021/04/25	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,218,000	98.59 515,839,285	99.00 518,005,336	0.625000 2018/04/30	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.29%
合計	98.29%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2015年8月	買建	221,000	42,464,466	42,745,820	0.03%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2015年8月	買建	262,000	8,519,913	8,580,500	0.01%
		米ドル買/円売 2015年8月	買建	1,776,000	217,246,893	220,277,280	0.13%
		ユーロ買/円売 2015年8月	買建	3,054,000	416,638,636	414,580,500	0.25%
		メキシコ・ペソ買/円売 2015年8月	買建	1,909,000	14,814,378	14,565,670	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2015年8月	買建	108,000	10,636,749	10,309,680	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2015年8月	買建	36,000	4,733,931	4,615,920	0.00%
		シンガポール・ドル買/円売 2015年8月	買建	62,000	5,629,947	5,599,220	0.00%
		豪ドル買/円売 2015年8月	買建	402,000	37,348,151	36,409,140	0.02%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2015年8月	買建	280,000	4,349,906	4,258,800	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2015年8月	買建	494,000	7,323,369	7,113,600	0.00%
		南アフリカ・ランド買/円売 2015年8月	買建	799,000	7,934,194	7,806,230	0.00%
デンマーク・クローネ買/円売 2015年8月	買建	558,000	10,214,577	10,150,020	0.01%		

(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) 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3) 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

2015年7月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,546円
純資産総額	1.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	1.7%
6カ月間	6.2%
1年間	17.7%
3年間	83.9%
5年間	85.5%
設定来	35.5%



※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信託報酬は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 08年12月	第2期 09年12月	第3期 10年12月	第4期 11年12月	第5期 12年12月	第6期 13年12月	第7期 14年12月			
分配金	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	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特徴値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,355	29.0%	日本円	59.2%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.3%
国内債券	278	23.7%	米ドル	22.3%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%
外国債券	728	18.7%	ユーロ	10.1%	修正デュレーション	三井住友フィナンシャルG	日本	0.5%
外国株式・先物	1,203	15.5%	英ポンド	3.5%	残存年数	みずほフィナンシャルG	日本	0.4%
外国リート	310	6.3%	豪ドル	1.2%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.4%
国内リート	52	5.9%	カナダ・ドル	1.1%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.4%
			スイス・フラン	0.7%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			シンガポール・ドル	0.4%	A	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
			香港ドル	0.3%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		1.2%	その他	1.2%	BB以下・無格付	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	3,926	-	合計	100.0%	合計	合計		5.4%

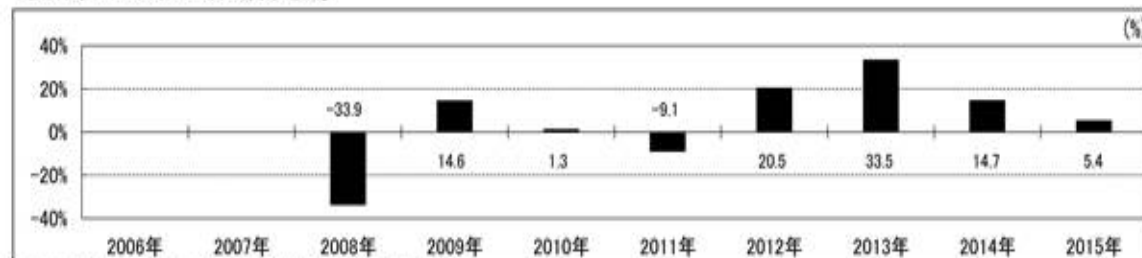
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

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。

・2008年は設定日(2月28日)から年末、2015年は7月31日までの騰落率を表しています。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年12月19日から平成27年6月18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・ターゲットイヤー2030

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		775,630
親投資信託受益証券		149,614,658
未収入金		263,000
流動資産合計		150,653,288
資産合計		150,653,288
負債の部		
流動負債		
未払解約金		266,912
未払受託者報酬		36,080
未払委託者報酬		433,403
その他未払費用		5,341
流動負債合計		741,736
負債合計		741,736
純資産の部		
元本等		
元本	1	111,461,754
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		38,449,798
（分配準備積立金）		27,213,075
元本等合計		149,911,552
純資産合計		149,911,552
負債純資産合計		150,653,288

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成26年12月19日 至 平成27年6月18日 金額(円)
営業収益	
受取利息	52
有価証券売買等損益	9,250,397
営業収益合計	9,250,449
営業費用	
受託者報酬	36,080
委託者報酬	433,403
その他費用	5,341
営業費用合計	474,824
営業利益	8,775,625
経常利益	8,775,625
中間純利益	8,775,625
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	575,345
期首剰余金又は期首欠損金()	23,250,214
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,348,753
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	9,348,753
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,349,449
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,349,449
中間剰余金又は中間欠損金()	38,449,798

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成26年12月19日 至 平成27年6月18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27年6月18日現在
1. 1期首元本額	90,614,046円
期中追加設定元本額	29,727,083円
期中一部解約元本額	8,879,375円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	111,461,754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26年12月19日 至 平成27年6月18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27年6月18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 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27年6月18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27年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.3450円

(1万口当たり純資産額)

(13,450円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券及び「外国債券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。

[次へ](#)

「トピックス・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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,917,685,777
株式	3 4	135,129,835,490
未収配当金		744,826,906
その他未収収益	5	19,264,511
流動資産合計		140,811,612,684
資産合計		140,811,612,684
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		14,800,521
前受金		2,142,000
未払金		1,304,932
未払解約金		174,696,000
未払利息		61,367
受入担保金		4,158,238,769
流動負債合計		4,351,243,589
負債合計		4,351,243,589
純資産の部		
元本等		
元本	1	143,066,313,801
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	6,605,944,706
元本等合計		136,460,369,095
純資産合計		136,460,369,095
負債純資産合計		140,811,612,684

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想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	平成27年6月18日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日
期首元本額	154,467,311,877円
期中追加設定元本額	5,025,922,337円
期中一部解約元本額	16,426,920,413円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
適格機関投資家専用投信1号	1,620,478,085円
トピックス・インデックスファン ド	5,725,094,481円
ダイワ・トピックス・インデッ クスファンドVA	18,325,022,039円
適格機関投資家専用・ダイワ・ トピックスインデックスファン ドVA2	188,519,130円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	207,242,078円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	3,342,644,132円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	155,739,418円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	4,618,215,291円
D-I's TOPIXインデッ クス	33,838,718円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,641,380,304円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,740,772,076円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,904,820,133円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,762,986,820円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,279,881,630円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	19,868,184円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	44,766,106円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	7,709,517円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	5,797,574円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	17,746,064円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	25,839,657円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	61,045,462円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	347,852,207円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	182,408,581円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	1,670,085,757円

ダイワ世界バランスファンド60VA	243,178,700円
ダイワ・バランスファンド35VA	16,472,438,271円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	421,144,418円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	744,082,136円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,352,611,458円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	229,431,271円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	321,109,835円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	584,094,991円
ダイワライフスタイル25	171,173,774円
ダイワライフスタイル50	573,743,808円
ダイワライフスタイル75	449,432,791円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	15,574,118,904円
計	143,066,313,801円
2. 期末日における受益権の総数	143,066,313,801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6,605,944,706円であります。
4. 3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,932,611,650円
5. 4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 818,400,000円
6. 5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分18,758,300円が含まれております。

(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27年6月18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 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

株式関連

種 類	平成27年6月18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	 1,225,839,000	 -	 1,211,250,000	 14,589,000
合計	1,225,839,000	-	1,211,250,000	14,589,000

(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。
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。

(1口当たり情報)

	平成27年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9538円 (9,538円)

[次へ](#)

「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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		566,413,144
コール・ローン		79,956,336
株式		80,221,488,605
投資証券		1,871,701,435
派生商品評価勘定		2,523,270
未収入金		115,876,831
未収配当金		137,219,168
差入委託証拠金		480,387,932
流動資産合計		83,475,566,721
資産合計		83,475,566,721
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		428,040
未払解約金		89,911,000
その他未払費用		2,630,341
流動負債合計		92,969,381
負債合計		92,969,381
純資産の部		
元本等		
元本	1	39,092,733,457
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		44,289,863,883
元本等合計		83,382,597,340
純資産合計		83,382,597,340
負債純資産合計		83,475,566,721

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>平成26年12月19日 40,934,323,072円 1,632,483,419円 3,474,073,034円</p>
<p>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V A ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募) D-I's 外国株式インデック ス DCダイワ外国株式インデック ス ダイワ・ライフ・バランス30 ダイワ・ライフ・バランス50 ダイワ・ライフ・バランス70</p>	<p>1,122,499,854円 47,118,346円 652,338,210円 70,338,029円 2,107,125,123円 1,061,262円 20,022,860,132円 394,818,637円 573,328,700円 447,892,836円</p>

大和DC海外株式インデックス ファンド	1,432,947,711円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	6,484,573円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	11,261,107円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	2,239,409円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	1,313,075円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	8,074,201円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	18,393,469円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	158,229,162円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	2,286,423,025円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	554,864,608円
ダイワ・バランスファンド35 VA	5,609,442,230円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	263,142,483円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	211,157,718円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,955,113,846円
ダイワライフスタイル25	19,535,235円
ダイワライフスタイル50	63,743,408円
ダイワライフスタイル75	50,987,068円
計	39,092,733,457円
2. 期末日における受益権の総数	39,092,733,457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27年6月18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 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27年6月18日 現在		
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)
			評価損益 (円)

		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,157,633,910	-	1,160,132,760	2,498,850
合計	1,157,633,910	-	1,160,132,760	2,498,850

(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27年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	163,862,980	-	164,266,600	403,620
アメリカ・ドル	111,075,060	-	111,051,000	24,060
イギリス・ポンド	17,597,160	-	17,596,800	360
スイス・フラン	18,538,240	-	18,776,800	238,560
ユーロ	16,652,520	-	16,842,000	189,480
合計	163,862,980	-	164,266,600	403,620

(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。

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。

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27年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1329円 (21,329円)

[次へ](#)

「ダイワ」- REIT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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,252,978,731	
投資証券	187,143,504,400	
未収配当金	777,914,952	
流動資産合計	190,174,398,083	
資産合計	190,174,398,083	
負債の部		
流動負債		
未払金	2,083,505,100	
未払解約金	24,000,000	
流動負債合計	2,107,505,100	
負債合計	2,107,505,100	
純資産の部		
元本等		
元本	1	79,736,048,946
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	108,330,844,037	
元本等合計	188,066,892,983	
純資産合計	188,066,892,983	
負債純資産合計	190,174,398,083	

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想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	平成27年6月18日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日
期首元本額	73,244,127,617円
期中追加設定元本額	8,978,681,140円
期中一部解約元本額	2,486,759,811円
期末元本額の内訳 ファンド名	

ダイワJ-REITオープン	9,197,441,942円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	67,332,540,904円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	377,079,098円
DC・ダイワJ-REITオープン	2,073,948,640円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,908,386円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	3,787,830円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	595,501円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	747,746,645円
計	79,736,048,946円
2. 期末日における受益権の総数	79,736,048,946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27年6月18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 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年6月18日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成27年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.3586円
(1万口当たり純資産額)	(23,586円)

[次へ](#)

「ダイワ・グローバルREIT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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		12,949,310
コール・ローン		17,585,526
投資証券		2,623,689,175
未収入金		18,980
未収配当金		3,956,840
流動資産合計		2,658,199,831
資産合計		2,658,199,831
負債の部		
流動負債		
未払金		4,124,576
未払株式払込金		385,148
未払解約金		1,284,000
流動負債合計		5,793,724
負債合計		5,793,724
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,235,202,031
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,417,204,076
元本等合計		2,652,406,107
純資産合計		2,652,406,107
負債純資産合計		2,658,199,831

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年6月18日現在	
1. 1期首		平成26年12月19日
期首元本額		1,002,906,361円
期中追加設定元本額		304,229,004円
期中一部解約元本額		71,933,334円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
D-I's グローバルREIT		4,656,760円
インデックス		
DCダイワ・グローバルREIT		1,016,996,890円
インデックスファンド		
DCダイワ・ターゲットイヤー		3,237,732円
2020		
DCダイワ・ターゲットイヤー		4,219,509円
2030		
DCダイワ・ターゲットイヤー		579,870円
2040		
ダイワ・インデックスセレクト		205,511,270円
グローバルREIT		
計		1,235,202,031円
2. 期末日における受益権の総数		1,235,202,031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27年6月18日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年6月18日 現在

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年6月18日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1473円 (21,473円)

[次へ](#)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		86,885,741
国債証券		10,091,385,880
地方債証券		1,872,410,824
特殊債券		1,497,315,650
社債券		1,230,496,639
未収利息		58,582,488
前払費用		2,667,902
流動資産合計		14,839,745,124
資産合計		14,839,745,124
負債の部		
流動負債		
未払金		7,276,730
未払解約金		34,155,000
流動負債合計		41,431,730
負債合計		41,431,730
純資産の部		
元本等		
元本	1	12,240,365,032
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,557,948,362
元本等合計		14,798,313,394
純資産合計		14,798,313,394
負債純資産合計		14,839,745,124

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年6月18日現在
1. 1 期首	平成26年12月19日
期首元本額	12,150,667,512円
期中追加設定元本額	983,385,739円
期中一部解約元本額	893,688,219円
期末元本額の内訳	

ファンド名	
ダイワ・ライフ・バランス30	3,843,418,684円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,030,516,907円
ダイワ・ライフ・バランス70	633,886,936円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	483,819,792円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	396,279,526円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	118,832,002円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	51,635,882円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	29,920,708円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,172,533円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	3,406,413,815円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	297,593,138円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	344,767,676円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	602,107,433円
計	12,240,365,032円
2. 期末日における受益権の総数	12,240,365,032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27年6月18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 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成27年6月18日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成27年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2090円 (12,090円)

[次へ](#)

「外国債券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27年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		157,833,052
コール・ローン		816,099,114
国債証券		164,956,513,554
派生商品評価勘定		10,528,344
未収入金		4,894,571
未収利息		1,528,037,267
前払費用		37,408,785
流動資産合計		167,511,314,687
資産合計		167,511,314,687
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		694,483
未払金		452,297
未払解約金		105,499,000
流動負債合計		106,645,780
負債合計		106,645,780
純資産の部		
元本等		
元本	1	57,447,512,305
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		109,957,156,602
元本等合計		167,404,668,907
純資産合計		167,404,668,907
負債純資産合計		167,511,314,687

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26年12月19日 至 平成27年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等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	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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	平成26年12月19日 58,254,679,882円 1,954,009,791円 2,761,177,368円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスV A	1,938,953,094円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	68,789,459円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	482,608,793円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	120,063,595円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,555,408,172円
D-I's 外国債券インデックス	458,841円
DCダイワ外国債券インデックス	34,720,768,253円
ダイワ・ライフ・バランス30	436,919,087円
ダイワ・ライフ・バランス50	210,765,219円
ダイワ・ライフ・バランス70	132,025,904円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	200,951,057円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	165,013,799円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	49,373,178円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	10,037,540円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,859,050円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	484,959円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,981,902,818円
ダイワ世界バランスファンド60VA	206,124,028円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,247,609,361円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	569,894,528円

ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	376,211,796円
ダイワ・バランスファンド25 VA（適格機関投資家専用）	443,124,899円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	62,334,687円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,370,367,483円
ダイワライフスタイル25	28,707,540円
ダイワライフスタイル50	46,151,566円
ダイワライフスタイル75	12,603,599円
計	57,447,512,305円
2. 期末日における受益権の総数	57,447,512,305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27年6月18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 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

通貨関連

種 類	平成27年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	604,510,906	-	614,344,767	9,833,861
アメリカ・ドル	196,903,592	-	196,281,670	621,922
イギリス・ポンド	108,592,077	-	111,998,580	3,406,503
オーストラリア・ ドル	23,217,223	-	23,350,949	133,726
カナダ・ドル	47,103,858	-	47,702,050	598,192
シンガポール・ ドル	4,954,248	-	4,987,979	33,731
スイス・フラン	4,201,555	-	4,293,120	91,565
スウェーデン・ クローナ	6,453,023	-	6,736,080	283,057
デンマーク・ クローネ	9,307,121	-	9,617,020	309,899

ノルウェー・ クローネ	3,886,766	-	3,933,280	46,514
ポーランド・ ズロチ	7,650,997	-	7,866,080	215,083
メキシコ・ペソ	14,723,222	-	14,768,100	44,878
ユーロ	170,340,484	-	175,705,680	5,365,196
南アフリカ・ ランド	7,176,740	-	7,104,179	72,561
合計	604,510,906	-	614,344,767	9,833,861

(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。

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。

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27年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.9140円
(1万口当たり純資産額)	(29,140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27年7月31日

資産総額	153,444,693円
負債総額	218,513円
純資産総額（ - ）	153,226,180円
発行済数量	113,112,855口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3546円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成27年7月31日

資産総額	142,992,248,767円
負債総額	3,861,552,859円
純資産総額（ - ）	139,130,695,908円
発行済数量	141,979,197,734口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9799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27年7月31日

資産総額	82,923,095,363円
負債総額	162,779,688円
純資産総額（ - ）	82,760,315,675円
発行済数量	38,727,837,098口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1370円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

平成27年7月31日

資産総額	194,887,410,609円
負債総額	2,276,280,873円

純資産総額（ - ）	192,611,129,736円
発行済数量	83,806,068,622口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2983円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成27年7月31日

資産総額	2,686,170,247円
負債総額	14,540,632円
純資産総額（ - ）	2,671,629,615円
発行済数量	1,229,569,374口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1728円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

純資産額計算書

平成27年7月31日

資産総額	14,815,969,529円
負債総額	128,621,000円
純資産総額（ - ）	14,687,348,529円
発行済数量	12,106,552,299口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2132円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成27年7月31日

資産総額	168,463,913,512円
負債総額	241,803,277円
純資産総額（ - ）	168,222,110,235円
発行済数量	57,874,547,931口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.9067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27年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年7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	26	190,055
追加型株式投資信託	583	12,272,198
株式投資信託 合計	609	12,462,253
単位型公社債投資信託	1	6,181
追加型公社債投資信託	17	3,367,012
公社債投資信託 合計	18	3,373,192
総合計	627	15,835,445

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26年4月1日から平成27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、従来、千円単位で記載しておりましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに変更しております。
なお、記載金額は表示単位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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	252	255
器具備品	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	-
投資その他の資産	15,077	12,979
投資有価証券	8,338	6,667

関係会社株式	5,141	5,129
出資金	129	124
長期差入保証金	997	996
投資不動産	1 398	1 -
その他	74	60
貸倒引当金	3	-
固定資産計	18,320	15,995
資産合計	57,727	63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	53	64
未払金	8,998	9,172
未払収益分配金	7	5
未払償還金	77	72
未払手数料	4,277	4,965
その他未払金	2 4,635	2 4,127
未払費用	3,463	4,162
未払法人税等	1,530	1,133
未払消費税等	530	1,429
賞与引当金	955	1,092
その他	1	747
流動負債計	15,534	17,801
固定負債		
退職給付引当金	1,959	2,072
役員退職慰労引当金	80	101
繰延税金負債	1,789	1,745
その他	3	2
固定負債計	3,832	3,920
負債合計	19,366	21,722
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	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092
福利厚生費	793	831
交際費	37	45

旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17
法人税等合計		6,375		6,220
当期純利益		10,126		13,431

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	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	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

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

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) 有形固定資産及び投資不動産

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	8～47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) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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)

(貸借対照表)

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。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、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。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、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。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、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。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、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。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、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

(損益計算書)

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。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、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」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」に表示していた「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。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、「営業外費用」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。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、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

3 保証債務

前事業年度(平成26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(平成27年3月31日)

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

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25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26年 6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年 3月31日
効力発生日	平成26年 6月26日

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

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

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

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

(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、「証券投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26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	15,186	15,186	-
(2) 未収委託者報酬	8,265	8,265	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	22,283	22,283	-
資産計	45,735	45,735	-
(1) 未払手数料	4,277	4,277	-
(2) その他未払金	4,635	4,635	-
(3) 未払費用(*)	2,678	2,678	-
負債計	11,591	11,591	-

(*) 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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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26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	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
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	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：百万円)

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

(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26年3月31日）

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)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27年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成26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	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)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27年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	164	55	109
(2) その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

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170百万円であります。

(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	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、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以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

[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25年4月1日 至 平成26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)	1,719	-	-

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依りて保証状にて定められております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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25年4月1日 至 平成26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)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	678	未払費用	393
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

< 訂正後 >

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

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

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成27年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成27年3月末日現在）

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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成27年3月末日現在）

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

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年7月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2030の平成26年12月19日から平成27年6月18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・ターゲットイヤー2030の平成27年6月18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26年12月19日から平成27年6月18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27年 5月28日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27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。