

【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28年9月9日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 岩本 信之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 山村 政
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3111

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** DCダイワ・ターゲットイヤー2040

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】** 継続申込期間（平成28年3月12日から平成29年3月10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28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】

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

1 内外の株式、債券、リートおよび短期金融資産に投資し、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

◆2040年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

<2016年6月時点の基本配分比率>

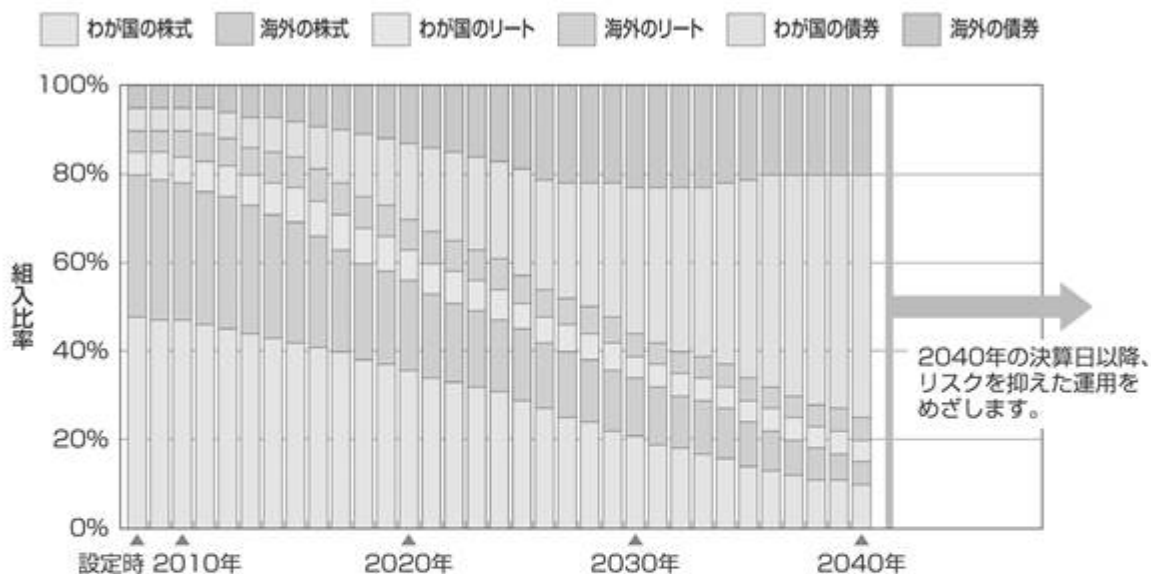
	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	41%	25%	8%	7%	10%	9%

<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2040	48%	32%	5%	5%	5%	5%

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



(注1) 2016年6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。2015年以前は過去の基本配分比率を示しています。

(注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。

(注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成28年6月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 更新後 >

< 略 >

職務権限

< 略 >

□ . Deputy-CIO (0~5名程度)

< 略 >

ハ. インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

< 略 >

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

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30~40名程度です。

< 略 >

上記の運用体制は平成28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。

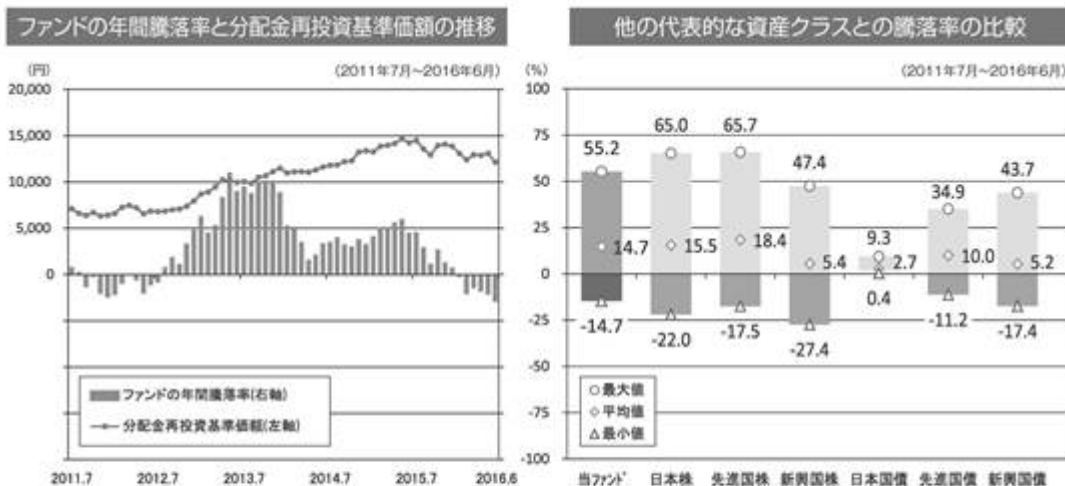
3 【投資リスク】

< 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ロクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIロクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 更新後 >

< 略 >

() 上記は、平成28年6月末現在のもので、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28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	21,511,215	99.79
内 日本	21,511,215	99.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,296	0.21
純資産総額	21,555,511	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28年6月30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	11,618,800	0.8887 10,326,165	0.7513 8,729,204	40.50
2	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	3,177,132	1.9590 6,224,282	1.6892 5,366,811	24.90
3	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	1,659,333	1.2464 2,068,207	1.3100 2,173,726	10.08
4	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	757,589	2.8089 2,128,025	2.5473 1,929,806	8.95
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	720,521	2.3204 1,671,955	2.4760 1,784,009	8.28
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	758,520	2.1447 1,626,807	2.0140 1,527,659	7.09

(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	99.79%
合計	99.79%

(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)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (平成25年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (平成26年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
平成27年6月末日	17,636,856	-	1.4249	-
7月末日	21,511,921	-	1.4509	-
8月末日	20,186,026	-	1.3584	-
9月末日	19,856,554	-	1.2917	-
10月末日	21,851,887	-	1.3958	-
11月末日	22,375,138	-	1.4091	-
第8計算期間末 (平成27年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
12月末日	22,864,160	-	1.3873	-
平成28年1月末日	21,583,615	-	1.3096	-
2月末日	20,788,493	-	1.2405	-
3月末日	22,404,650	-	1.2948	-
4月末日	22,320,698	-	1.2883	-
5月末日	22,823,938	-	1.3089	-
6月末日	21,555,511	-	1.2151	-

【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
第8計算期間	0.0000
平成27年12月19日～ 平成28年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5
第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7
第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9
第8計算期間	6.5
平成27年12月19日～ 平成28年6月18日	11.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	126,328	0
第2計算期間	556,781	0
第3計算期間	701,153	1,082,781
第4計算期間	974,376	122,837
第5計算期間	4,521,213	2,261,666
第6計算期間	4,772,167	334,316
第7計算期間	2,261,839	449,310
第8計算期間	6,366,392	910,747
平成27年12月19日～ 平成28年6月18日	1,773,277	520,137

(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28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	106,503,221,970	98.26
内 日本	106,503,221,970	98.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,880,810,831	1.74
純資産総額	108,384,032,801	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)	1,967,890,000	1.82
内 日本	1,967,890,000	1.82

(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28年6月30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	717,000	7,086.76 5,081,212,269	5,052.00 3,622,284,000	3.34
2	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	439,600	4,342.14 1,908,808,183	4,800.00 2,110,080,000	1.95
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,563,700	719.59 3,284,020,226	455.90 2,080,590,830	1.92
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	323,200	5,921.65 1,913,877,765	5,789.00 1,871,004,800	1.73
5	KDDI	日本	株式	情報・通信業	564,400	2,730.09 1,540,867,687	3,113.00 1,756,977,200	1.62
6	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	381,700	4,004.34 1,528,459,952	4,103.00 1,566,115,100	1.44
7	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,500	3,674.63 1,905,296,525	2,572.50 1,333,841,250	1.23
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	454,700	4,549.98 2,068,878,880	2,926.00 1,330,452,200	1.23
9	ソニー	日本	株式	電気機器	407,600	3,022.15 1,231,832,337	2,988.00 1,217,908,800	1.12
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,019,400	227.14 1,821,566,344	148.30 1,189,277,020	1.10
11	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	424,600	2,163.42 918,591,920	2,766.50 1,174,655,900	1.08
12	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	676,000	1,578.57 1,067,116,310	1,600.00 1,081,600,000	1.00
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	240,000	5,470.54 1,312,931,008	4,424.00 1,061,760,000	0.98
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	237,900	5,280.87 1,256,320,716	4,281.00 1,018,449,900	0.94
15	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	105,200	10,179.91 1,070,927,170	9,433.00 992,351,600	0.92
16	ファナック	日本	株式	電気機器	59,000	19,570.19 1,154,641,298	16,535.00 975,565,000	0.90

17	花王	日本	株式	化学	162,200	5,122.12 830,808,166	5,929.00 961,683,800	0.89
18	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,500	18,814.43 968,943,330	18,125.00 933,437,500	0.86
19	キヤノン	日本	株式	電気機器	309,200	3,515.45 1,086,978,624	2,912.50 900,545,000	0.83
20	キーエンス	日本	株式	電気機器	13,000	53,000.53 689,007,000	69,140.00 898,820,000	0.83
21	三菱地所	日本	株式	不動産業	422,000	2,388.45 1,007,929,070	1,873.00 790,406,000	0.73
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	230,400	4,311.38 993,342,752	3,367.00 775,756,800	0.72
23	三菱商事	日本	株式	卸売業	425,300	2,073.86 882,013,897	1,788.00 760,436,400	0.70
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	615,000	1,110.20 682,773,826	1,208.00 742,920,000	0.69
25	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	805,900	1,111.00 895,355,070	917.90 739,735,610	0.68
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	84,000	6,951.66 583,939,933	8,514.00 715,176,000	0.66
27	三井不動産	日本	株式	不動産業	301,000	3,110.56 936,280,450	2,331.50 701,781,500	0.65
28	村田製作所	日本	株式	電気機器	60,900	16,045.35 977,162,179	11,380.00 693,042,000	0.64
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	203,200	4,150.62 843,406,592	3,269.00 664,260,800	0.61
30	信越化学	日本	株式	化学	107,800	6,116.56 659,365,894	5,962.00 642,703,600	0.59

(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	98.26%
合計	98.26%

(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	0.12%
鉱業	0.29%
建設業	3.29%
食料品	5.30%
繊維製品	0.73%
パルプ・紙	0.27%
化学	6.17%
医薬品	5.94%
石油・石炭製品	0.50%
ゴム製品	0.82%
ガラス・土石製品	0.86%
鉄鋼	1.14%
非鉄金属	0.82%

金属製品	0.61%
機械	4.62%
電気機器	11.62%
輸送用機器	8.82%
精密機器	1.58%
その他製品	1.61%
電気・ガス業	1.94%
陸運業	4.68%
海運業	0.22%
空運業	0.62%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	8.63%
卸売業	4.08%
小売業	5.02%
銀行業	6.99%
証券、商品先物取引業	0.91%
保険業	2.10%
その他金融業	1.20%
不動産業	2.68%
サービス業	3.86%
合計	98.26%

(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 2016年9月	買建	158	2,062,678,326	1,967,890,000	1.82%

(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28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		64,674,252,931	95.66
	内 香港	854,224,547	1.26
	内 シンガポール	336,229,113	0.50
	内 イスラエル	206,453,157	0.31
	内 ノルウェー	172,733,359	0.26

内 スウェーデン	746,356,655	1.10
内 デンマーク	534,049,759	0.79
内 イギリス	5,200,494,240	7.69
内 アイルランド	121,952,552	0.18
内 オランダ	836,014,073	1.24
内 ベルギー	398,051,297	0.59
内 フランス	2,498,378,131	3.70
内 ドイツ	2,351,330,063	3.48
内 スイス	2,509,597,004	3.71
内 ポルトガル	39,421,482	0.06
内 スペイン	796,938,279	1.18
内 イタリア	524,851,633	0.78
内 フィンランド	261,085,211	0.39
内 オーストリア	43,090,256	0.06
内 カナダ	2,630,978,694	3.89
内 アメリカ	41,793,720,526	61.82
内 オーストラリア	1,768,243,074	2.62
内 ニューージーランド	50,059,826	0.07
投資証券	1,934,247,140	2.86
内 香港	35,411,162	0.05
内 シンガポール	26,616,736	0.04
内 イギリス	74,271,131	0.11
内 フランス	107,769,507	0.16
内 カナダ	17,564,760	0.03
内 アメリカ	1,486,878,502	2.20
内 オーストラリア	185,735,342	0.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,002,171,380	1.48
純資産総額	67,610,671,451	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)	957,124,746	1.42
内 アメリカ	957,124,746	1.42
為替予約取引(買建)	462,187,000	0.68
内 日本	462,187,000	0.68

(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28年6月30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	122,700	12,065.06 1,480,383,803	9,714.70 1,191,994,181	1.76
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	91,905	8,363.59 768,664,495	9,515.05 874,481,461	1.29
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	167,150	5,541.39 926,252,569	5,201.07 869,359,085	1.29
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,100	10,557.22 645,047,907	12,280.25 750,323,293	1.11
5	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	8,860	69,092.43 612,159,301	73,642.39 652,471,629	0.97
6	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	207,100	3,122.28 646,643,752	3,143.90 651,101,794	0.96
7	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	50,750	10,892.81 552,814,869	11,748.20 596,221,434	0.88
8	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	135,991	3,474.34 472,483,775	4,377.79 595,340,230	0.88
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	72,550	8,007.06 580,918,172	7,853.98 569,806,430	0.84
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	60,187	7,816.11 470,430,003	8,635.17 519,725,464	0.77
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	107,372	5,676.92 609,543,039	4,833.68 519,002,179	0.77
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,170	6,886.84 559,005,566	6,298.09 511,216,128	0.76
13	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	90,154	4,685.90 422,458,457	5,666.22 510,832,813	0.76
14	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	136,463	3,368.45 459,678,177	3,602.87 491,659,691	0.73
15	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	6,877	77,022.88 529,686,983	70,401.76 484,152,904	0.72
16	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,450	79,226.39 511,010,256	71,542.00 461,445,919	0.68
17	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	41,618	9,307.07 387,346,053	10,642.95 442,938,385	0.66
18	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,650	9,267.17 478,650,776	8,379.33 432,792,524	0.64
19	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	15,850	28,879.43 457,739,974	26,708.79 423,334,385	0.63
20	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	91,550	4,444.27 406,875,679	4,573.32 418,687,483	0.62
21	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	26,350	13,861.66 365,255,993	14,625.56 385,383,748	0.57
22	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	28,050	13,842.32 388,277,526	13,107.64 367,669,490	0.54

23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,971	5,551.17 344,017,958	5,871.01 363,832,702	0.54
24	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	54,470	6,322.48 344,387,934	6,580.06 358,416,162	0.53
25	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	34,250	9,021.19 308,976,778	10,148.98 347,602,709	0.51
26	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,500	11,819.83 407,785,712	9,980.21 344,317,307	0.51
27	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	104,300	3,535.67 368,780,760	3,285.91 342,721,070	0.51
28	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	32,200	10,366.22 333,793,833	10,612.07 341,708,950	0.51
29	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	42,700	8,192.97 349,840,487	7,897.31 337,215,282	0.50
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	111,400	2,805.42 312,525,177	2,908.23 323,977,557	0.48

(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	95.66%
投資証券	2.86%
合計	98.52%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	7.45%
素材	4.65%
資本財・サービス	9.84%
一般消費財・サービス	11.71%
生活必需品	11.25%
ヘルスケア	13.54%
金融	16.07%
情報技術	14.09%
電気通信サービス	3.40%
公益事業	3.67%
その他	0.00%
合計	95.66%

(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 2016年9月	買建	18	964,613,918	957,124,746	1.42%

為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2016年7月	買建	100,000	10,506,500	10,507,000	0.02%
		米ドル買/円売 2016年7月	買建	3,400,000	349,849,800	349,860,000	0.52%
		ユーロ買/円売 2016年7月	買建	560,000	64,055,880	64,058,400	0.09%
		英ポンド買/円売 2016年7月	買建	120,000	16,608,000	16,608,000	0.02%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2016年7月	買建	350,000	4,256,875	4,256,000	0.01%
		豪ドル買/円売 2016年7月	買建	120,000	9,206,820	9,207,600	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2016年7月	買建	500,000	7,690,500	7,690,000	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) 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。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（平成28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(%)
投資証券	225,633,279,700	98.93
内 日本	225,633,279,700	98.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,441,686,400	1.07
純資産総額	228,074,966,100	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(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,369,088,000	1.04
内 日本	2,369,088,000	1.04

(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) 不動産投信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28年6月30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	27,474	656,676.61 18,041,533,244	633,000.00 17,391,042,000	7.63

2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	25,476	663,583.08 16,905,442,610	634,000.00 16,151,784,000	7.08
3	日本リートファンド	日本	投資証券	49,660	260,239.93 12,923,515,335	262,100.00 13,015,886,000	5.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	72,421	158,688.83 11,492,404,436	162,700.00 11,782,896,700	5.17
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	57,232	179,139.19 10,252,494,345	185,100.00 10,593,643,200	4.64
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	35,840	250,299.87 8,970,747,538	251,000.00 8,995,840,000	3.94
7	オリックス不動産投資	日本	投資証券	47,113	172,429.65 8,123,678,493	177,300.00 8,353,134,900	3.66
8	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	16,986	458,444.02 7,787,130,180	441,000.00 7,490,826,000	3.28
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	25,295	279,192.03 7,062,162,509	275,300.00 6,963,713,500	3.05
10	GLP投資法人	日本	投資証券	50,469	126,169.22 6,367,634,748	129,800.00 6,550,876,200	2.87
11	API投資法人	日本	投資証券	11,668	586,356.80 6,841,611,254	544,000.00 6,347,392,000	2.78
12	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	9,417	685,407.75 6,454,484,829	609,000.00 5,734,953,000	2.51
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	64,636	95,740.93 6,188,310,999	86,500.00 5,591,014,000	2.45
14	森ヒルズリート	日本	投資証券	34,063	166,172.04 5,660,318,446	161,200.00 5,490,955,600	2.41
15	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	9,651	517,462.04 4,994,026,218	534,000.00 5,153,634,000	2.26
16	森トラスト総合リート	日本	投資証券	25,684	206,224.92 5,296,680,855	194,800.00 5,003,243,200	2.19
17	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,878	647,639.56 5,102,104,462	613,000.00 4,829,214,000	2.12
18	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	71,523	80,553.44 5,761,424,373	64,800.00 4,634,690,400	2.03
19	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,428	434,709.52 4,098,441,365	468,000.00 4,412,304,000	1.93
20	大和ハウズリート	日本	投資証券	6,824	495,295.20 3,379,894,509	604,000.00 4,121,696,000	1.81
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,123	239,469.83 4,100,442,009	239,700.00 4,104,383,100	1.80
22	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	14,549	239,211.39 3,480,286,639	279,100.00 4,060,625,900	1.78
23	産業ファンド	日本	投資証券	6,860	513,876.85 3,525,195,248	573,000.00 3,930,780,000	1.72
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	18,621	187,482.19 3,491,105,982	187,800.00 3,497,023,800	1.53
25	プレミア投資法人	日本	投資証券	25,626	137,233.02 3,516,733,525	135,100.00 3,462,072,600	1.52
26	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	24,603	147,373.14 3,625,821,568	140,600.00 3,459,181,800	1.52

27	イオンリート投資	日本	投資証券	25,479	138,506.82 3,529,015,479	117,500.00 2,993,782,500	1.31
28	福岡リート投資法人	日本	投資証券	14,535	196,041.20 2,849,458,871	203,400.00 2,956,419,000	1.30
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	19,022	158,528.06 3,015,520,773	146,100.00 2,779,114,200	1.22
30	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	31,912	84,769.41 2,705,161,515	84,200.00 2,686,990,400	1.18

(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	98.93%
合計	98.93%

(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
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2016年9月	買建	1,296	2,416,661,068	2,369,088,000	1.04%

(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) 不動産投信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・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28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(%)
投資証券	2,980,067,207	98.67
内 ガーンジー	1,493,824	0.05
内 マン島	1,958,252	0.06
内 香港	51,235,447	1.70
内 シンガポール	89,859,034	2.98
内 イスラエル	958,008	0.03
内 イギリス	140,853,512	4.66
内 アイルランド	6,388,155	0.21

内 オランダ	14,120,010	0.47
内 ベルギー	19,408,031	0.64
内 フランス	125,549,833	4.16
内 ドイツ	5,561,875	0.18
内 スペイン	11,898,328	0.39
内 イタリア	2,401,767	0.08
内 カナダ	58,296,466	1.93
内 アメリカ	2,190,377,958	72.53
内 オーストラリア	245,697,070	8.14
内 ニューゼーランド	14,009,637	0.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	40,075,698	1.33
純資産総額	3,020,142,905	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)	24,360,800	0.81
内 日本	24,360,800	0.81

(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28年6月30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	8,247	19,671.04 162,227,118	22,118.44 182,410,827	6.04
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	3,900	24,959.99 97,344,216	26,140.16 101,946,659	3.38
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	9,500	6,590.04 62,605,607	7,771.76 73,831,750	2.44
4	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	13,946	4,483.58 62,528,569	5,053.91 70,481,830	2.33
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	2,600	27,765.08 72,189,444	26,601.39 69,163,626	2.29
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	9,700	8,166.11 79,212,194	6,998.90 67,889,418	2.25
7	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	8,979	5,659.02 50,812,731	7,414.66 66,576,282	2.20
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	3,600	18,698.74 67,315,695	18,333.41 66,000,299	2.19
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	4,100	12,915.20 52,952,690	13,532.66 55,483,927	1.84
10	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	140,500	316.09 44,413,838	370.65 52,076,915	1.72

11	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	4,764	9,958.18 47,441,222	10,193.23 48,560,574	1.61
12	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	6,817	5,326.41 36,310,817	7,045.21 48,027,255	1.59
13	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	15,377	2,692.02 41,396,183	3,073.92 47,267,694	1.57
14	HCP INC	アメリカ	投資証券	12,400	3,650.52 45,267,126	3,639.92 45,135,091	1.49
15	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	3,900	7,658.56 29,868,701	11,134.86 43,425,962	1.44
16	LINK REIT	香港	投資証券	59,000	622.70 36,740,102	715.37 42,207,243	1.40
17	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	50,500	741.99 37,471,142	817.28 41,272,691	1.37
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,767	23,948.39 42,316,861	23,105.35 40,827,159	1.35
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	11,200	2,745.43 30,749,650	3,181.97 35,638,145	1.18
20	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	19,900	1,689.67 33,626,249	1,651.70 32,868,939	1.09
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	1,900	15,318.35 29,104,903	16,875.18 32,062,845	1.06
22	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	3,300	8,693.63 28,689,044	9,401.85 31,026,130	1.03
23	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	21,300	1,679.32 35,770,239	1,414.55 30,129,919	1.00
24	MACERICH CO/THE	アメリカ	投資証券	3,400	8,166.42 27,765,941	8,637.23 29,366,603	0.97
25	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	2,700	11,893.30 32,112,108	10,601.78 28,624,828	0.95
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	7,000	3,858.30 27,008,318	3,747.98 26,235,875	0.87
27	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	6,400	3,114.05 19,930,361	4,070.09 26,048,579	0.86
28	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	9,100	2,118.19 19,276,021	2,698.30 24,554,532	0.81
29	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	23,708	860.73 20,406,739	1,028.07 24,373,505	0.81
30	KLEPIERRE	フランス	投資証券	5,000	4,812.38 24,062,490	4,559.01 22,795,067	0.75

(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	98.67%
合計	98.67%

(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	米ドル買/円売 2016年7月	買建	228,000	23,460,516	23,461,200	0.78%
		英ポンド買/円売 2016年7月	買建	6,500	899,600	899,600	0.03%

(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28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(%)
国債証券	10,827,567,840	74.46
内 日本	10,827,567,840	74.46
地方債証券	1,349,144,400	9.28
内 日本	1,349,144,400	9.28
特殊債券	933,093,000	6.42
内 日本	933,093,000	6.42
社債券	1,228,966,258	8.45
内 日本	1,228,966,258	8.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	201,990,400	1.39
純資産総額	14,540,761,898	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28年6月30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	104.10 176,977,600	107.34 182,478,000	0.600000 2024/06/20	1.25
2	333 10年国債	日本	国債証券	155,000,000	103.39 160,254,500	107.14 166,074,750	0.600000 2024/03/20	1.14

3	338 10年国債	日本	国債証券	145,000,000	101.27 146,841,500	106.11 153,869,650	0.400000 2025/03/20	1.06
4	125 5年国債	日本	国債証券	148,000,000	100.30 148,456,700	101.77 150,622,560	0.100000 2020/09/20	1.04
5	339 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	101.11 141,559,300	106.20 148,681,400	0.400000 2025/06/20	1.02
6	342 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	101.98 142,783,500	103.43 144,803,400	0.100000 2026/03/20	1.00
7	341 10年国債	日本	国債証券	136,000,000	102.82 139,845,520	105.38 143,318,160	0.300000 2025/12/20	0.99
8	319 10年国債	日本	国債証券	129,000,000	106.26 137,085,720	107.86 139,145,850	1.100000 2021/12/20	0.96
9	116 5年国債	日本	国債証券	133,000,000	100.60 133,809,970	101.25 134,666,490	0.200000 2018/12/20	0.93
10	126 5年国債	日本	国債証券	124,000,000	101.30 125,619,970	101.87 126,328,720	0.100000 2020/12/20	0.87
11	332 10年国債	日本	国債証券	118,000,000	103.45 122,075,250	106.99 126,251,740	0.600000 2023/12/20	0.87
12	340 10年国債	日本	国債証券	118,000,000	101.02 119,209,650	106.28 125,410,400	0.400000 2025/09/20	0.86
13	325 10年国債	日本	国債証券	110,000,000	104.99 115,496,740	107.10 117,810,000	0.800000 2022/09/20	0.81
14	335 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	102.58 107,718,800	106.69 112,026,600	0.500000 2024/09/20	0.77
15	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.83 107,980,050	105.63 108,803,020	1.100000 2020/06/20	0.75
16	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.74 105,744,000	106.41 106,414,000	1.300000 2020/06/20	0.73
17	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	104.86 104,868,900	105.85 105,858,900	1.084000 2021/09/17	0.73
18	305 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.15 105,157,000	105.61 105,617,000	1.300000 2019/12/20	0.73
19	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.79 105,796,200	105.55 105,559,700	1.570000 2019/11/25	0.73
20	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.16 104,169,900	105.50 105,509,600	0.800000 2022/11/25	0.73
21	21 - 35 兵庫県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.48 105,487,400	105.42 105,421,100	1.460000 2020/01/22	0.73
22	24 - 16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.84 103,849,000	105.37 105,376,700	0.757000 2023/01/31	0.72
23	98 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	104.98 104,989,100	105.14 105,142,300	1.300000 2020/01/31	0.72
24	190 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	102.99 102,998,900	105.10 105,108,700	0.605000 2023/05/31	0.72
25	117 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.62 103,620,200	105.06 105,060,000	0.720000 2022/12/22	0.72
26	70 東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	104.83 104,833,100	104.95 104,956,100	1.193000 2020/09/29	0.72
27	5 日本政策投資CO	日本	特殊債券	100,000,000	105.30 105,305,400	104.82 104,823,700	1.745000 2019/03/20	0.72

28	21 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.15 105,154,000	104.74 104,748,200	1.570000 2019/05/27	0.72
29	122 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	103.93 103,933,500	104.53 104,536,700	0.900000 2020/11/30	0.72
30	76 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.74 104,749,700	104.50 104,501,100	1.400000 2019/07/25	0.72

(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	74.46%
地方債証券	9.28%
特殊債券	6.42%
社債券	8.45%
合計	98.61%

(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28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(%)
国債証券	144,622,709,656	97.78
内 ユーロ	58,713,724,372	39.70
内 シンガポール	522,307,960	0.35
内 マレーシア	684,460,523	0.46
内 ノルウェー	354,487,699	0.24
内 スウェーデン	715,614,623	0.48
内 デンマーク	1,006,288,975	0.68
内 イギリス	11,373,444,649	7.69
内 スイス	403,073,382	0.27
内 ポーランド	822,613,225	0.56
内 カナダ	3,009,934,847	2.04
内 アメリカ	62,293,164,788	42.12

内 メキシコ	1,318,734,284	0.89
内 南アフリカ	658,870,566	0.45
内 オーストラリア	2,745,989,763	1.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,281,122,409	2.22
純資産総額	147,903,832,065	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)	1,144,108,650	0.77
内 日本	1,144,108,650	0.77

(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28年6月30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	6,143,000	97.99 619,482,033	104.64 661,509,102	2.000000 2025/08/15	0.45
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,410,000	99.55 656,737,433	100.09 660,292,963	0.625000 2017/08/31	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	100.45 612,090,375	106.75 650,502,545	2.250000 2024/11/15	0.44
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	100.95 606,726,724	106.81 641,934,138	2.250000 2025/11/15	0.43
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	99.14 590,520,549	105.72 629,749,602	2.125000 2025/05/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,662,000	101.55 591,731,211	107.73 627,740,614	2.375000 2024/08/15	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.22 580,527,574	104.71 618,848,801	2.000000 2025/02/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	102.71 572,086,791	108.69 605,375,628	2.500000 2024/05/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.79 563,924,452	110.46 594,446,413	2.750000 2024/02/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	98.67 544,918,395	101.26 559,200,580	1.625000 2026/02/15	0.38
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	167.00 478,932,675	182.07 522,144,042	5.750000 2032/10/25	0.35
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,484,000	157.95 448,820,916	182.13 517,515,692	4.500000 2041/04/25	0.35
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,397,000	130.13 505,670,608	132.36 514,355,434	4.250000 2023/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,974,000	99.53 509,494,124	100.07 512,253,127	0.625000 2017/09/30	0.35

15	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	153.70 500,903,858	155.64 507,236,038	6.000000 2031/05/01	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,468,000	103.21 474,598,304	108.42 498,558,580	2.500000 2023/08/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.97 472,374,970	103.25 497,836,433	1.750000 2023/05/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	104.42 484,535,566	107.10 497,008,456	2.625000 2020/11/15	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	154.78 464,415,605	164.84 494,597,128	5.500000 2029/04/25	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,581,000	115.41 425,324,492	132.57 488,547,905	3.750000 2043/11/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	108.53 478,065,235	110.03 484,636,820	3.625000 2020/02/15	0.33
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	118.65 481,839,563	119.14 483,821,255	3.250000 2021/10/25	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,617,000	112.75 419,684,217	129.53 482,147,373	3.625000 2044/02/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,035,000	99.82 414,494,414	115.47 479,504,678	3.000000 2045/05/15	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.99 457,000,106	132.55 477,019,727	3.500000 2026/04/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,480,000	118.15 470,332,192	119.18 474,464,233	3.000000 2022/04/25	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	109.36 458,752,086	111.87 469,272,172	3.625000 2021/02/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,998,000	97.66 401,823,077	112.94 464,694,334	2.875000 2043/05/15	0.31
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,424,000	146.13 405,215,975	165.84 459,865,589	4.000000 2038/10/25	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,325,000	100.05 445,326,096	102.29 455,304,918	1.500000 2019/11/30	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	97.78%
合計	97.78%

(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	豪ドル買/円売 2016年7月	買建	354,000	28,348,957	27,155,340	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2016年7月	買建	263,000	22,309,685	20,921,650	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2016年7月	買建	39,000	4,368,093	4,098,120	0.00%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2016年7月	買建	647,000	10,747,140	9,950,860	0.01%
		ユーロ買/円売 2016年7月	買建	3,872,000	478,162,960	442,918,080	0.30%
		英ポンド買/円売 2016年7 月	買建	654,000	105,923,062	90,500,520	0.06%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2016年7月	買建	943,000	6,557,801	6,563,280	0.00%
		マレーシア・リングギット 買/円売 2016年7月	買建	400,000	10,083,200	10,244,000	0.01%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2016年7月	買建	298,000	3,943,974	3,653,480	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2016年7月	買建	332,000	9,338,493	8,588,840	0.01%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2016年7月	買建	590,000	7,859,686	7,174,400	0.00%
		シンガポール・ドル買/円 売 2016年7月	買建	70,000	5,617,248	5,346,600	0.00%
		米ドル買/円売 2016年7月	買建	4,796,000	531,569,743	493,460,440	0.33%
メキシコ・ペソ買/円売 2016年7月	買建	2,434,000	14,545,340	13,533,040	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

2016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	12,151円
純資産総額	21百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-7.2%
3カ月間	-6.2%
6カ月間	-12.4%
1年間	-14.7%
3年間	22.1%
5年間	66.9%
設定来	21.5%



※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運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期		
	08年12月	09年12月	10年12月	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月	15年12月		
分配金	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	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	1,401	40.5%	日本円	59.1%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.4%	
外国株式・先物	1,250	24.2%	米ドル	25.3%	最終利回り(%)	日本電信電話	日本	0.8%	
国内債券	259	9.9%	ユーロ	7.0%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%	
外国債券	744	8.8%	英ポンド	3.0%	残存年数	TOPIX先物 2809月	日本	0.7%	
国内リート・先物	55	8.3%	豪ドル	1.5%	債券格付別構成	ソフトバンクグループ	日本	0.7%	
外国リート	320	7.7%	カナダ・ドル	1.3%	AAA	27.7%	日本ビルファンド	日本	0.6%
			スイス・フラン	1.0%	AA	59.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			香港ドル	0.4%	A	4.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.5%
			シンガポール・ドル	0.4%	BBB	7.2%	日本リテールファンド	日本	0.5%
コール・ローン、その他	1.8%		その他	1.0%	BB以下・無格付	1.9%	野村不動産マスターF	日本	0.4%
合計	4,029	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.0%	

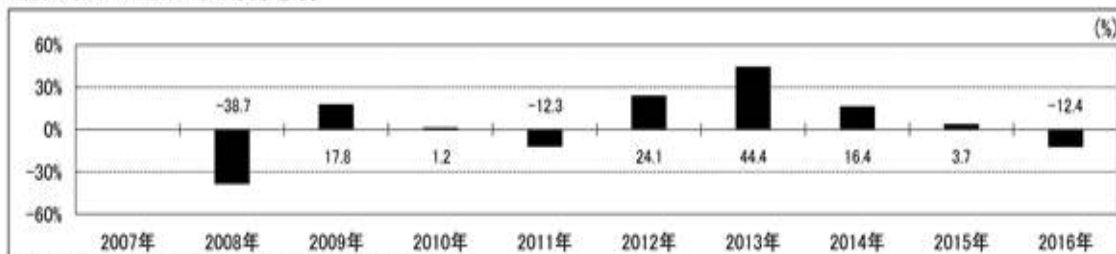
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.9%保有しております。

※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欄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、2016年は6月30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27年12月19日から平成28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2040

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		101,441
親投資信託受益証券		21,153,428
流動資産合計		21,254,869
資産合計		21,254,869
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		4,528
未払委託者報酬		53,076
その他未払費用		751
流動負債合計		58,355
負債合計		58,355
純資産の部		
元本等		
元本	1	17,371,732
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,824,782
（分配準備積立金）		4,361,325
元本等合計		21,196,514
純資産合計		21,196,514
負債純資産合計		21,254,869

[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27年12月19日 至 平成28年6月18日 金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	2,654,730
営業収益合計	2,654,730
営業費用	
受託者報酬	4,528
委託者報酬	53,076
その他費用	751
営業費用合計	58,355
営業利益又は営業損失()	2,713,085
経常利益又は経常損失()	2,713,085
中間純利益又は中間純損失()	2,713,085
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()	49,555
期首剰余金又は期首欠損金()	6,151,952
剰余金増加額又は欠損金減少額	530,911
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	530,911
剰余金減少額又は欠損金増加額	194,551
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	194,551
中間剰余金又は中間欠損金()	3,824,782

[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27年12月19日 至 平成28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28年6月18日現在
1. 1期首元本額	16,118,592円
期中追加設定元本額	1,773,277円
期中一部解約元本額	520,137円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	17,371,732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27年12月19日 至 平成28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28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28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28年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.2202円

(1万口当たり純資産額)

(12,202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28年6月18日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,722,157,836
株式	3 4	106,971,243,070
未収配当金		800,222,339
未収利息		10,718
前払金		115,967,000
その他未収収益	5	2,420,595
流動資産合計		109,612,021,558
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		105,125,866
未払解約金		25,398,000
未払利息		2,514
受入担保金		1,146,468,330
流動負債合計		1,276,994,710
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	143,829,179,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	35,494,152,745
元本等合計		108,335,026,848
純資産合計		
負債純資産合計		
		109,612,021,558

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27年12月19日 至 平成28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。 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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められ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	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>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>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。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28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27年12月19日 140,729,416,146円 8,516,529,565円 5,416,766,118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	1,613,511,354円
トピックス・インデックス	5,962,878,439円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	15,187,956,277円
デックスファンドVA	
適格機関投資家専用・ダイ	125,893,773円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファ	190,009,530円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	2,861,982,465円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国際分散バランスファ	120,733,955円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国際分散バランスファ	4,007,867,464円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	
D-I's TOPIXイン	33,309,102円
デックス	
為替ヘッジ付米回国債プラス	11,789,677円
日本株式ファンド	
DCダイワ・ターゲットイ	594,958円
ヤー2050	
DCダイワ日本株式インデッ	63,513,402,304円
クス	
ダイワ・ライフ・バランス3	2,405,376,037円
0	
ダイワ・ライフ・バランス5	2,376,254,220円
0	
ダイワ・ライフ・バランス7	2,155,821,948円
0	
年金ダイワ日本株式インデッ	3,682,925,051円
クス	
DCダイワ・ターゲットイ	26,722,780円
ヤー2020	
DCダイワ・ターゲットイ	59,820,699円
ヤー2030	
DCダイワ・ターゲットイ	11,271,055円
ヤー2040	

	ダイワ世界分散バランスファンド15VA		448,097円
	ダイワ世界分散バランスファンド20VA		440,730円
	ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)		941,908円
	ダイワ世界分散バランスファンド25VA		67,963,626円
	ダイワ世界分散バランスファンド30VA		372,696,872円
	ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)		203,905,819円
	ダイワ世界バランスファンド40VA		1,626,855,846円
	ダイワ世界バランスファンド60VA		250,770,230円
	ダイワ・バランスファンド35VA		15,409,790,802円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA		434,819,547円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA		739,075,396円
	ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)		1,343,959,558円
	ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)		212,438,595円
	ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)		327,038,769円
	ダイワ・ノーロードTOPIXファンド		21,630,864円
	ダイワ・インデックスセレクトTOPIX		928,900,024円
	ダイワライフスタイル25		222,547,714円
	ダイワライフスタイル50		681,998,825円
	ダイワライフスタイル75		521,236,837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)		16,113,598,446円
	計		143,829,179,593円
2.	期末日における受益権の総数		143,829,179,593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35,494,152,745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 1,064,242,200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 542,100,000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2,217,211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28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

株式関連

種 類	平成28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				
株価指数 先物取引				
買 建	1,462,117,000	-	1,357,050,000	105,067,000
合計	1,462,117,000	-	1,357,050,000	105,067,000

（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28年6月18日現在
1口当たり純資産額	0.7532円
（1万口当たり純資産額）	（7,532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28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		401,099,281
コール・ローン		53,113,765
株式		65,482,873,259
投資証券		1,895,675,147
未収入金		580,553
未収配当金		140,095,354
差入委託証拠金		437,462,499
流動資産合計		68,410,899,858
資産合計		68,410,899,858
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		7,433,211
未払解約金		55,645,000
未払利息		77
流動負債合計		63,078,288
負債合計		63,078,288
純資産の部		
元本等		
元本	1	39,749,545,522
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,598,276,048
元本等合計		68,347,821,570
純資産合計		68,347,821,570
負債純資産合計		68,410,899,858

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27年12月19日 至 平成28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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 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。</p> <p>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>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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</p> <p>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</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28年6月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日
期首元本額	38,798,220,086円
期中追加設定元本額	2,248,600,885円
期中一部解約元本額	1,297,275,449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	760,172,107円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	42,295,165円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	538,982,580円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	54,182,846円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,765,132,340円
D-I's 外国株式インデックス	1,891,638円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	178,044円
DCダイワ外国株式インデックス	21,349,126,758円
ダイワ・ライフ・バランス30	530,865,224円
ダイワ・ライフ・バランス50	697,544,377円
ダイワ・ライフ・バランス70	530,382,227円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,410,071,398円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	8,200,030円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,628,568円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,033,140円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	100,000円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	197,107円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	20,225,892円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	166,648,116円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,171,993,646円
ダイワ世界バランスファンド60VA	557,881,230円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,338,833,622円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	255,950,926円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	355,437,802円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	7,631,171円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,009,403,366円
ダイワライフスタイル25	24,686,743円
ダイワライフスタイル50	75,720,619円
ダイワライフスタイル75	58,148,840円
計	39,749,545,522円
2. 期末日における受益権の総数	39,749,545,522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28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

株式関連

種 類	平成28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				
株価指数 先物取引				
買 建	929,062,448	-	921,629,237	7,433,211
合計	929,062,448	-	921,629,237	7,433,211

(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。

(1口当たり情報)

	平成28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)	1.7195円 (17,195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28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,148,062,050
投資証券	2	215,832,847,200
未収配当金		865,587,405
前払金		69,993,600
流動資産合計		218,916,490,255
資産合計		218,916,490,255
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		84,122,976
未払金		651,745,050
未払解約金		20,380,000
未払利息		3,136
流動負債合計		756,251,162
負債合計		756,251,162
純資産の部		
元本等		
元本	1	89,606,133,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		128,554,105,840
元本等合計		218,160,239,093
純資産合計		218,160,239,093
負債純資産合計		218,916,490,255

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27年12月19日 至 平成28年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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、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。 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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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>

3. 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28年6月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日
期首元本額	89,610,737,405円
期中追加設定元本額	7,236,302,447円
期中一部解約元本額	7,240,906,599円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	8,201,986,736円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	77,051,200,202円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	466,743,660円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	19,606円
DC・ダイワJ-REIT オープン	2,812,299,954円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,241,944円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,241,703円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	708,837円
ダイワ・ノーロード J-RE ITファンド	41,158,143円
ダイワ・インデックスセレク ト J-REIT	1,024,532,468円
計	89,606,133,253円
2. 期末日における受益権の総数	89,606,133,253口
3. 2 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。 投資証券 372,000,000円

(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28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

不動産投信関連

種 類	平成28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				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	2,373,585,600	-	2,289,600,000	83,985,600
合計	2,373,585,600	-	2,289,600,000	83,985,600

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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28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)	2.4347円 (24,347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28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		3,817,782
コール・ローン		34,964,717
投資証券		2,921,684,983
未収入金		29,841
未収配当金		4,614,169
流動資産合計		2,965,111,492
資産合計		2,965,111,492
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,153
未払金		15,055,464
未払利息		51
流動負債合計		15,057,668
負債合計		15,057,668
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,472,382,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,477,671,454
元本等合計		2,950,053,824
純資産合計		2,950,053,824
負債純資産合計		2,965,111,492

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27年12月19日 至 平成28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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買取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</p> <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>
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</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28年6月18日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日
期首元本額	1,288,622,228円
期中追加設定元本額	198,000,113円
期中一部解約元本額	14,239,971円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
D - I ' s グローバル R E I	1,574,163円
T インデックス	
D C ダイワ・ターゲットイ	24,009円
ヤー2050	
D C ダイワ・グローバル R E	1,189,462,118円
I T インデックスファンド	
D C ダイワ・ターゲットイ	3,989,702円
ヤー2020	
D C ダイワ・ターゲットイ	5,182,858円
ヤー2030	
D C ダイワ・ターゲットイ	753,798円
ヤー2040	

ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	260,130,470円
ダイワ・ノーロード グローバル REITファンド	11,265,252円
計	1,472,382,370円
2. 期末日における受益権の総数	1,472,382,370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28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

通貨関連

種 類	平成28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)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	14,816,868	-	14,814,715	2,153
アメリカ・ドル	13,300,189	-	13,298,170	2,019
イギリス・ポンド	388,780	-	388,752	28
ユーロ	1,127,899	-	1,127,793	106
合計	14,816,868	-	14,814,715	2,153

(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28年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.0036円
(1万口当たり純資産額)	(20,036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28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	70,226,707	
国債証券	11,073,304,200	
地方債証券	1,347,580,200	
特殊債券	931,313,200	
社債券	1,328,671,012	
未収入金	31,429,880	
未収利息	52,205,984	
前払費用	1,239,287	
流動資産合計	14,835,970,470	
資産合計	14,835,970,470	
負債の部		
流動負債		
未払解約金	31,700,000	
未払利息	102	
流動負債合計	31,700,102	
負債合計	31,700,102	
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,392,866,268
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,411,404,100	
元本等合計	14,804,270,368	
純資産合計	14,804,270,368	
負債純資産合計	14,835,970,470	

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27年12月19日 至 平成28年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成28年6月18日現在

1.	1 期首	平成27年12月19日
	期首元本額	12,066,650,337円
	期中追加設定元本額	796,096,037円
	期中一部解約元本額	1,469,880,106円
	期末元本額の内訳	
	ファンド名	
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	38,685円
	ダイワ・ライフ・バランス3 0	4,139,137,160円
	ダイワ・ライフ・バランス5 0	1,976,292,357円
	ダイワ・ライフ・バランス7 0	590,423,339円
	DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	481,847,168円
	DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コ ース)	392,817,910円
	DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	115,732,343円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	60,741,664円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	34,719,343円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,739,815円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,613,710,530円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	241,658,650円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	275,401,005円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	468,606,299円
	計	11,392,866,268円
2.	期末日における受益権の総数	11,392,866,268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28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

平成28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28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）	1.2994円 (12,994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28年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		232,385,872
コール・ローン		1,386,420,890
国債証券		147,221,965,690
未収利息		1,163,736,866
前払費用		33,299,852
流動資産合計		150,037,809,170
資産合計		150,037,809,170
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		76,906,780
未払解約金		152,387,890
未払利息		2,024
流動負債合計		229,296,694
負債合計		229,296,694
純資産の部		
元本等		
元本	1	57,795,375,088
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		92,013,137,388
元本等合計		149,808,512,476
純資産合計		149,808,512,476
負債純資産合計		150,037,809,170

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27年12月19日 至 平成28年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 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。 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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p>

	<p>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>
<p>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>	<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28年6月18日現在
<p>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>	<p>平成27年12月19日 57,214,334,756円 2,438,670,769円 1,857,630,437円</p>
<p>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VA 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 外国債券インデックス DCダイワ・ターゲットイヤー2050 DCダイワ外国債券インデックス 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 DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)</p>	<p>1,552,362,069円 56,570,512円 370,354,857円 86,576,167円 1,210,050,944円 840,107円 18,731円 36,818,456,353円 547,765,810円 239,146,820円 144,784,956円 234,618,613円 189,917,723円</p>

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	56,170,613円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	12,345,448円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,064,328円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	753,022円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,755,176,944円
ダイワ世界バランスファンド60VA	193,202,410円
ダイワ・バランスファンド35VA	7,381,997,271円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	530,993,354円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	338,464,832円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	400,591,569円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	90,395,193円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	5,196,077円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,465,969,918円
ダイワライフスタイル25	33,577,032円
ダイワライフスタイル50	51,795,585円
ダイワライフスタイル75	13,217,830円
計	57,795,375,088円
2. 期末日における受益権の総数	57,795,375,088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28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

通貨関連

種類	平成28年6月18日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
		うち 1年超	

市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	133,910,100	-	134,651,600	741,500
イギリス・ポンド	44,538,900	-	44,856,000	317,100
カナダ・ドル	24,171,900	-	24,321,000	149,100
メキシコ・ペソ	44,088,000	-	44,240,000	152,000
ユーロ	21,111,300	-	21,234,600	123,300
買 建	1,453,365,870	-	1,377,200,590	76,165,280
アメリカ・ドル	631,322,197	-	596,029,440	35,292,757
イギリス・ポンド	122,119,249	-	112,685,300	9,433,949
オーストラリア・ドル	28,348,957	-	27,350,040	998,917
カナダ・ドル	31,640,732	-	30,220,460	1,420,272
シンガポール・ドル	5,617,248	-	5,434,800	182,448
スイス・フラン	4,368,093	-	4,233,060	135,033
スウェーデン・クローナ	7,859,686	-	7,428,100	431,586
デンマーク・クローネ	10,747,140	-	10,267,890	479,250
ノルウェー・クローネ	3,943,974	-	3,730,960	213,014
ポーランド・ズロチ	9,338,493	-	8,844,480	494,013
メキシコ・ペソ	14,545,340	-	13,435,680	1,109,660
ユーロ	576,956,960	-	551,109,120	25,847,840
南アフリカ・ランド	6,557,801	-	6,431,260	126,541
合計	1,587,275,970	-	1,511,852,190	76,906,780

(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28年6月18日現在	
1口当たり純資産額	2.5921円

(1万口当たり純資産額)	
--------------	--

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28年6月30日

資産総額	21,557,785円
負債総額	2,274円
純資産総額（ - ）	21,555,511円
発行済数量	17,739,229口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2151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28年6月30日

資産総額	109,761,606,827円
負債総額	1,377,574,026円
純資産総額（ - ）	108,384,032,801円
発行済数量	144,262,230,454口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7513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28年6月30日

資産総額	68,090,265,977円
負債総額	479,594,526円
純資産総額（ - ）	67,610,671,451円
発行済数量	40,026,007,537口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6892円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

平成28年6月30日

資産総額	231,154,259,312円
負債総額	3,079,293,212円

純資産総額（ - ）	228,074,966,100円
発行済数量	92,112,721,781口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.4760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28年6月30日

資産総額	3,050,869,712円
負債総額	30,726,807円
純資産総額（ - ）	3,020,142,905円
発行済数量	1,499,569,766口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0140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28年6月30日

資産総額	14,855,273,898円
負債総額	314,512,000円
純資産総額（ - ）	14,540,761,898円
発行済数量	11,100,047,764口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3100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28年6月30日

資産総額	148,042,246,306円
負債総額	138,414,241円
純資産総額（ - ）	147,903,832,065円
発行済数量	58,063,442,838口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5473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28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

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28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	47	177,997
追加型株式投資信託	639	11,118,280
株式投資信託 合計	686	11,296,277
単位型公社債投資信託	8	71,943
追加型公社債投資信託	15	2,174,714
公社債投資信託 合計	23	2,246,657
総合計	709	13,542,934

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27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	255	243
器具備品	21	18
器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049

その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
固定負債		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		

繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837

交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215
法人税等調整額		17		6
法人税等合計		6,220		6,209
当期純利益		13,431		13,262

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

	株主資本					
	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	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	141	55	86
（2）その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

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

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

4．減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度170百万円、当事業年度172百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

通常の実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

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

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

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成28年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
第一生命保険株式会社	343,146	（注2）

（注1）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。

（注2）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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28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28年7月22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2040の平成27年12月19日から平成28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2040の平成28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27年12月19日から平成28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28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

(注)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。