

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書の訂正届出書

**【提出先】** 関東財務局長 殿

**【提出日】** 平成29年9月12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29年3月11日から平成30年3月9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29年3月10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 <略>

<略>

##### <2017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2040	40%	23%	8%	7%	12%	10%

<略>

##### ファンドの基本配分比率のイメージ

<略>

(注1) 2017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。2016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性があるため、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>

4 <略>

<略>

## 東証REIT指数とは

●「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

[算出方法の概要]

指数：算出時の時価総額<sup>(注1)</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>(注2)</sup> × 1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 平成15年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

- ①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ②(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ③本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

## 5 < 略 >

< 略 >

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の構成銘柄の全てに投資することをめざします。

ベンチマークへの運動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

(平成29年10月4日から)

- ・運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

## S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

[特徴]

- ・世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- ・1989年から過去データを算出しています。
- ・配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's® およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S&P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

&lt; 略 &gt;

## (3) 【ファンドの仕組み】

&lt; 更新後 &gt;

&lt; 略 &gt;

&lt; 委託会社の概況（平成29年7月末日現在） &gt;

&lt; 略 &gt;

## 2 【投資方針】

## (3) 【運用体制】

&lt; 更新後 &gt;

&lt; 略 &gt;

上記の運用体制は平成29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。

## (5) 【投資制限】

&lt; 更新後 &gt;

&lt; 略 &gt;

&lt; 参考 &gt; 各マザーファンドの概要

&lt; 略 &gt;

3. ダイワJ - REITマザーファンド

&lt; 略 &gt;

(注) 東証REIT指数とは

「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

[ 算出方法の概要 ]

指数：算出時の時価総額<sup>(注1)</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>(注2)</sup> × 1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 平成15年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有します。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本商品は、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

<平成29年10月3日まで>

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．約束手形
  - ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
- 3．外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 5．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 6．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

<平成29年10月4日から>

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

海外の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

#### 投資態度

イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限りません。）

## 八．約束手形

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

3．外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

6．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

< 略 >

## 3 【投資リスク】

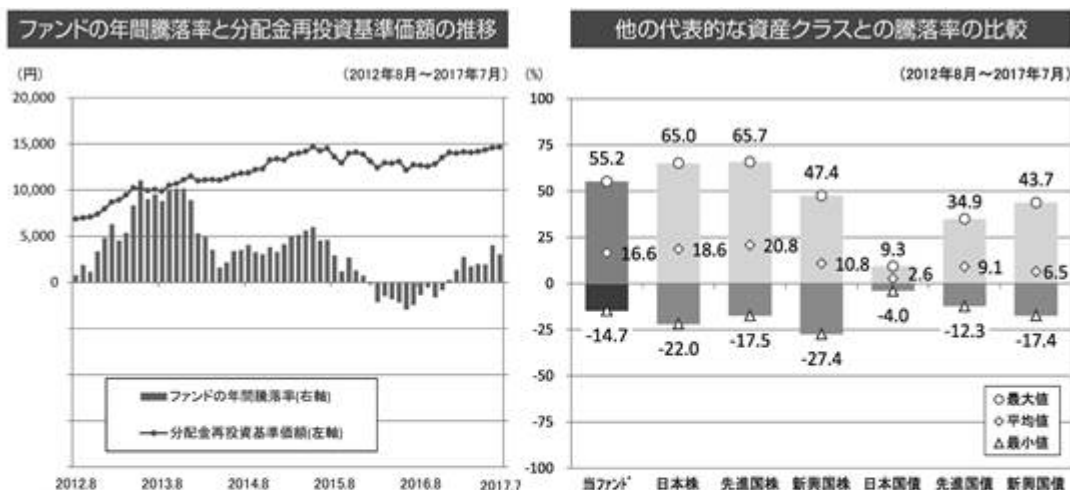
< 更新後 >

< 略 >



## 参 考 情 報

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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

### ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

### ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権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29年7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29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	34,071,944	99.80
内 日本	34,071,944	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	68,275	0.20
純資産総額	34,140,219	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成29年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	13,686,841	0.9433 12,911,004	0.9971 13,647,149	39.97
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	3,496,108	2.0963 7,329,154	2.2241 7,775,693	22.78
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	3,243,785	1.2649 4,103,138	1.2634 4,098,197	12.00
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	1,239,623	2.6924 3,337,580	2.7350 3,390,368	9.93
5	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,165,163	2.4384 2,841,141	2.3888 2,783,341	8.15
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	1,090,207	2.1562 2,350,799	2.1805 2,377,196	6.96

(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	99.80%
合計	99.80%

(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
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
平成28年7月末日	21,955,435	-	1.2719	-
8月末日	22,564,718	-	1.2662	-
9月末日	24,827,580	-	1.2555	-
10月末日	25,345,511	-	1.2823	-
11月末日	27,680,899	-	1.3513	-
第9計算期間末 (平成28年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
12月末日	29,313,077	-	1.4043	-
平成29年1月末日	29,607,455	-	1.3975	-
2月末日	30,479,766	-	1.4116	-
3月末日	31,310,380	-	1.4051	-
4月末日	31,592,234	-	1.4151	-
5月末日	33,007,673	-	1.4348	-
6月末日	33,909,808	-	1.4580	-
7月末日	34,140,219	-	1.4640	-

## 【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
第9計算期間	0.0000
平成28年12月20日～ 平成29年6月19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
第9計算期間	2.3
平成28年12月20日～ 平成29年6月19日	2.8

## (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
第9計算期間	5,468,224	1,102,640
平成28年12月20日～ 平成29年6月19日	2,895,754	432,550

(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29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		131,752,290,460	99.12
	内 日本	131,752,290,460	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,174,011,725	0.88
純資産総額		132,926,302,185	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)	1,085,065,000	0.82
	内 日本	1,085,065,000
		0.82

(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29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	680,000	5,951.77 4,047,210,270	6,234.00 4,239,120,000	3.19
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,174,500	516.25 2,155,124,435	700.00 2,922,150,000	2.20
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	443,400	4,617.78 2,047,525,060	5,390.00 2,389,926,000	1.80
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	249,100	6,485.27 1,615,481,542	8,958.00 2,231,437,800	1.68
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	444,000	3,441.71 1,528,121,594	4,195.00 1,862,580,000	1.40
6	ソニー	日本	株式	電気機器	395,400	3,322.29 1,313,636,964	4,540.00 1,795,116,000	1.35
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	546,500	3,067.06 1,676,148,440	2,920.00 1,595,780,000	1.20
8	本田技研	日本	株式	輸送用機器	503,100	2,966.30 1,492,349,638	3,108.00 1,563,634,800	1.18
9	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,516,200	174.48 1,311,493,916	196.40 1,476,181,680	1.11
10	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	347,600	3,964.29 1,377,988,883	3,834.00 1,332,698,400	1.00
11	任天堂	日本	株式	その他製品	34,500	27,292.05 941,575,864	37,480.00 1,293,060,000	0.97
12	キーエンス	日本	株式	電気機器	25,200	36,730.00 925,596,000	51,020.00 1,285,704,000	0.97
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	219,000	4,649.83 1,018,314,663	5,832.00 1,277,208,000	0.96
14	ファナック	日本	株式	電気機器	56,400	16,972.68 957,259,618	22,565.00 1,272,666,000	0.96

15	キヤノン	日本	株式	電気機器	299,600	2,916.34 873,736,745	3,837.00 1,149,565,200	0.86
16	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	107,700	9,004.05 969,736,525	10,350.00 1,114,695,000	0.84
17	信越化学	日本	株式	化学	104,700	7,037.67 736,844,816	10,110.00 1,058,517,000	0.80
18	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	402,900	2,559.68 1,031,296,856	2,563.00 1,032,632,700	0.78
19	日立	日本	株式	電気機器	1,354,000	476.06 644,588,900	759.60 1,028,498,400	0.77
20	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	231,300	4,545.22 1,051,310,633	4,445.00 1,028,128,500	0.77
21	東京海上HD	日本	株式	保険業	221,000	3,902.06 862,357,094	4,645.00 1,026,545,000	0.77
22	三菱電機	日本	株式	電気機器	599,700	1,257.60 754,185,277	1,710.50 1,025,786,850	0.77
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,000	13,375.62 789,161,954	17,180.00 1,013,620,000	0.76
24	三菱商事	日本	株式	卸売業	418,600	2,128.41 890,952,436	2,396.50 1,003,174,900	0.75
25	パナソニック	日本	株式	電気機器	646,800	1,023.46 661,980,240	1,521.00 983,782,800	0.74
26	花王	日本	株式	化学	138,000	5,662.41 781,412,600	6,714.00 926,532,000	0.70
27	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	197,500	3,636.22 718,154,777	4,657.00 919,757,500	0.69
28	ダイキン工業	日本	株式	機械	76,800	9,385.63 720,816,570	11,700.00 898,560,000	0.68
29	日本電産	日本	株式	電気機器	72,900	9,067.68 661,034,473	12,160.00 886,464,000	0.67
30	三菱地所	日本	株式	不動産業	415,000	1,877.62 779,216,477	2,006.00 832,490,000	0.63

(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	99.12%
合計	99.12%

(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	0.11%
鉱業	0.31%
建設業	3.14%
食料品	4.51%
繊維製品	0.71%
パルプ・紙	0.25%
化学	7.02%
医薬品	4.49%
石油・石炭製品	0.49%

ゴム製品	0.95%
ガラス・土石製品	0.99%
鉄鋼	1.29%
非鉄金属	0.98%
金属製品	0.69%
機械	5.19%
電気機器	13.48%
輸送用機器	8.60%
精密機器	1.62%
その他製品	2.11%
電気・ガス業	1.78%
陸運業	4.02%
海運業	0.22%
空運業	0.56%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	7.89%
卸売業	4.32%
小売業	4.53%
銀行業	7.64%
証券、商品先物取引業	1.08%
保険業	2.46%
その他金融業	1.27%
不動産業	2.39%
サービス業	3.83%
合計	99.12%

(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 2017年9月	買建	67	1,075,141,180	1,085,065,000	0.82%

(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29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		84,480,701,192	95.81
	内 香港	1,197,673,560	1.36



内 シンガポール	442,754,839	0.50
内 イスラエル	236,543,744	0.27
内 ノルウェー	239,095,392	0.27
内 スウェーデン	1,034,042,401	1.17
内 デンマーク	651,230,476	0.74
内 イギリス	6,303,577,655	7.15
内 アイルランド	152,898,292	0.17
内 オランダ	1,322,295,829	1.50
内 ベルギー	431,204,924	0.49
内 フランス	3,651,819,605	4.14
内 ドイツ	3,389,729,611	3.84
内 スイス	2,984,010,388	3.38
内 ポルトガル	52,182,829	0.06
内 スペイン	1,286,667,624	1.46
内 イタリア	857,154,382	0.97
内 フィンランド	363,940,384	0.41
内 オーストリア	87,444,258	0.10
内 カナダ	3,426,296,091	3.89
内 アメリカ	54,046,020,175	61.29
内 オーストラリア	2,262,905,550	2.57
内 ニュージーランド	61,213,183	0.07
投資証券	2,325,916,929	2.64
内 香港	59,465,540	0.07
内 シンガポール	37,743,052	0.04
内 イギリス	88,234,565	0.10
内 フランス	120,505,202	0.14
内 カナダ	16,807,577	0.02
内 アメリカ	1,699,923,472	1.93
内 オーストラリア	303,237,521	0.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,367,037,090	1.55
純資産総額	88,173,655,211	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)	1,499,286,828	1.70
内 アメリカ	1,499,286,828	1.70
為替予約取引(買建)	397,188,000	0.45
内 日本	397,188,000	0.45

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

(注4) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産（平成29年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	119,400	12,340.44 1,473,460,734	16,497.32 1,969,780,605	2.23
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	166,350	6,749.99 1,122,865,410	8,059.96 1,340,775,011	1.52
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	9,190	84,441.25 776,015,614	112,561.41 1,034,439,395	1.17
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	53,650	13,426.83 720,354,427	19,029.85 1,020,951,855	1.16
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,950	12,436.99 770,473,797	14,549.64 901,350,663	1.02
6	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	94,305	9,472.11 893,268,596	8,783.86 828,361,917	0.94
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,470	8,728.02 711,074,610	10,072.74 820,626,780	0.93
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,057	85,236.98 601,518,027	103,897.83 733,207,025	0.83
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,740	87,301.85 588,414,873	105,751.71 712,766,562	0.81
10	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	71,950	7,807.86 561,778,240	9,321.15 670,656,958	0.76
11	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	108,472	5,727.60 621,286,271	5,881.65 637,994,881	0.72
12	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	226,601	2,239.00 507,359,979	2,651.71 600,880,251	0.68
13	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	139,491	4,359.92 608,184,500	4,303.65 600,320,442	0.68
14	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	58,117	9,162.36 532,491,181	9,954.67 578,535,760	0.66
15	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・ サービス	197,600	3,426.36 677,050,218	2,817.23 556,685,735	0.63
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	28,200	17,449.97 492,091,193	19,200.90 541,465,380	0.61
17	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	42,968	12,070.96 518,668,385	11,931.04 512,653,013	0.58
18	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	458,000	917.18 420,082,088	1,077.77 493,620,419	0.56
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	134,763	3,526.45 475,238,624	3,658.10 492,976,867	0.56
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	92,704	5,619.24 520,930,132	5,290.17 490,420,754	0.56
21	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,850	8,011.62 415,405,137	9,315.44 483,006,005	0.55

22	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	93,450	4,541.67 424,423,039	5,077.20 474,464,667	0.54
23	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	108,540	3,871.74 420,244,779	4,361.03 473,346,413	0.54
24	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	62,823	6,126.63 384,893,402	7,440.90 467,459,692	0.53
25	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	42,550	8,734.20 371,640,316	10,941.20 465,548,166	0.53
26	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	21,876	17,412.23 380,910,168	21,093.40 461,439,273	0.52
27	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	35,250	10,041.51 353,963,703	13,077.57 460,984,642	0.52
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	16,350	25,860.20 422,815,215	27,666.82 452,352,589	0.51
29	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	27,550	14,303.56 394,063,271	16,340.62 450,184,301	0.51
30	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,971	6,863.43 432,204,147	7,074.53 445,490,764	0.51

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.81%
投資証券	2.64%
合計	98.45%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.46%
素材	4.79%
資本財・サービス	10.28%
一般消費財・サービス	11.36%
生活必需品	9.51%
ヘルスケア	12.55%
金融	18.37%
情報技術	15.99%
電気通信サービス	2.72%
公益事業	3.20%
不動産	0.57%
合計	95.81%

(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 2017年9月	買建	22	1,481,404,169	1,499,286,828	1.70%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2017年8月	買建	3,600,000	399,293,850	397,188,000	0.45%

(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29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		250,342,058,200	98.32
	内 日本	250,342,058,200	98.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,273,246,146	1.68
純資産総額		254,615,304,346	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)		3,685,600,000	1.45
	内 日本	3,685,600,000	1.45

(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29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	31,670	611,773.36 19,374,862,332	595,000.00 18,843,650,000	7.40
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	30,912	609,038.16 18,826,587,762	579,000.00 17,898,048,000	7.03
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	93,824	168,513.49 15,810,609,690	156,300.00 14,664,691,200	5.76
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	62,915	226,152.92 14,228,411,218	210,600.00 13,249,899,000	5.20
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	72,129	172,561.24 12,446,670,332	164,400.00 11,858,007,600	4.66

6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	63,096	174,852.03 11,032,463,841	167,400.00 10,562,270,400	4.15
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	33,636	283,851.06 9,547,614,297	273,200.00 9,189,355,200	3.61
8	日本プロロジスリート	日本	投資証券	38,257	240,863.47 9,214,714,106	232,500.00 8,894,752,500	3.49
9	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	20,648	436,266.65 9,008,033,959	414,500.00 8,558,596,000	3.36
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	30,279	302,790.07 9,168,180,776	269,400.00 8,157,162,600	3.20
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	94,389	78,292.29 7,389,931,716	79,700.00 7,522,803,300	2.95
12	API投資法人	日本	投資証券	14,135	533,791.71 7,545,145,962	495,500.00 7,003,892,500	2.75
13	GLP投資法人	日本	投資証券	57,256	128,958.15 7,383,628,267	120,000.00 6,870,720,000	2.70
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	9,559	651,150.46 6,224,347,278	623,000.00 5,955,257,000	2.34
15	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	11,125	494,854.65 5,505,258,079	471,500.00 5,245,437,500	2.06
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	10,867	487,366.11 5,296,207,545	458,000.00 4,977,086,000	1.95
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	35,132	149,948.85 5,268,003,158	138,900.00 4,879,834,800	1.92
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	20,776	235,049.13 4,883,380,910	224,000.00 4,653,824,000	1.83
19	産業ファンド	日本	投資証券	8,885	510,719.81 4,537,745,513	499,000.00 4,433,615,000	1.74
20	森トラスト総合リート	日本	投資証券	23,373	177,313.79 4,144,355,259	182,800.00 4,272,584,400	1.68
21	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,053	579,819.22 4,089,465,009	543,000.00 3,829,779,000	1.50
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	29,286	139,553.81 4,086,972,928	128,800.00 3,772,036,800	1.48
23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	20,971	182,060.35 3,817,987,603	173,700.00 3,642,662,700	1.43
24	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	72,922	47,427.49 3,458,507,812	49,400.00 3,602,346,800	1.41
25	イオンリート投資	日本	投資証券	28,693	126,869.69 3,640,272,118	120,900.00 3,468,983,700	1.36
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	29,539	124,898.12 3,689,365,861	112,500.00 3,323,137,500	1.31
27	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	36,785	81,201.70 2,987,004,602	82,100.00 3,020,048,500	1.19
28	東急リアル・エステート	日本	投資証券	21,927	137,199.12 3,008,365,143	134,200.00 2,942,603,400	1.16
29	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	11,892	254,759.75 3,029,602,984	241,900.00 2,876,674,800	1.13
30	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	24,796	122,644.93 3,041,103,752	114,600.00 2,841,621,600	1.12

(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	98.32%
合計	98.32%

(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 2017年9月	買建	2,168	3,764,315,744	3,685,600,000	1.45%

(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29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(%)
投資信託受益証券	27,857,858	0.25
内 アメリカ	27,857,858	0.25
投資証券	10,900,299,844	99.15
内 ガーンジー	6,644,509	0.06
内 マン島	6,030,372	0.05
内 香港	212,853,896	1.94
内 シンガポール	364,380,746	3.31
内 イスラエル	3,908,790	0.04
内 イギリス	603,429,024	5.49
内 アイルランド	26,896,893	0.24
内 オランダ	50,966,699	0.46
内 ベルギー	85,178,773	0.77
内 フランス	494,800,014	4.50
内 ドイツ	22,615,775	0.21
内 スペイン	97,428,702	0.89

内 イタリア	10,484,927	0.10
内 カナダ	196,869,772	1.79
内 アメリカ	7,799,469,619	70.94
内 オーストラリア	866,398,453	7.88
内 ニュージーランド	51,942,880	0.47
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	65,686,929	0.60
純資産総額	10,993,844,631	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)	39,797,120	0.36
内 日本	39,797,120	0.36

(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29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	27,347	19,597.27 535,927,867	17,713.38 484,407,858	4.41
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	46,446	5,762.25 267,635,638	6,792.04 315,463,206	2.87
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	13,100	23,598.23 309,138,164	22,383.39 293,222,461	2.67
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	32,100	7,369.61 236,566,621	8,063.27 258,831,111	2.35
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	12,100	19,175.40 232,022,814	21,242.37 257,032,738	2.34
6	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	8,780	27,946.70 245,373,064	27,673.79 242,975,898	2.21
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	32,200	6,857.81 220,822,544	7,471.79 240,591,912	2.19
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	31,079	6,893.01 214,229,408	7,406.69 230,192,581	2.09
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	13,500	14,040.38 189,546,013	13,499.11 182,238,059	1.66
10	LINK REIT	香港	投資証券	194,000	761.67 147,766,399	902.90 175,163,958	1.59
11	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	14,000	11,058.39 154,818,203	12,489.41 174,851,782	1.59
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	5,767	24,992.95 144,134,504	29,205.23 168,426,567	1.53
13	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	466,950	375.24 175,248,286	360.39 168,284,111	1.53

14	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	23,917	6,333.53 151,480,033	6,312.02 150,964,582	1.37
15	HCP INC	アメリカ	投資証券	41,000	3,338.30 136,872,687	3,512.44 144,010,061	1.31
16	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	64,800	1,971.62 127,763,664	2,064.64 133,789,223	1.22
17	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	15,064	8,941.32 134,693,656	8,713.23 131,256,187	1.19
18	GGP INC	アメリカ	投資証券	50,677	2,746.50 139,188,366	2,513.77 127,390,474	1.16
19	WESTFIELD CORP	オーストラリア	投資証券	166,400	786.88 130,937,490	691.77 115,111,027	1.05
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	9,928	10,661.57 105,849,159	11,444.39 113,619,988	1.03
21	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	7,900	12,442.62 98,297,430	13,286.14 104,960,506	0.95
22	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	69,890	1,466.06 102,467,530	1,471.14 102,818,044	0.94
23	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	8,900	11,789.35 104,925,470	11,393.63 101,403,374	0.92
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	23,200	3,892.70 90,313,320	4,338.96 100,663,918	0.92
25	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	30,900	2,896.46 89,503,722	3,185.80 98,441,359	0.90
26	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	138,620	620.74 86,049,128	696.16 96,502,808	0.88
27	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	11,000	8,072.43 88,797,762	8,598.47 94,583,192	0.86
28	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	12,720	7,368.62 93,729,944	7,300.75 92,865,616	0.84
29	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	6,300	15,257.10 96,120,356	14,655.58 92,330,176	0.84
30	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	37,000	2,688.12 99,463,404	2,252.24 83,333,010	0.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.25%
投資証券	99.15%
合計	99.40%

(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 2017年8月	買建	95,000	8,349,749	8,349,550	0.08%
		カナダ・ドル買/円売 2017年8月	買建	70,000	6,197,310	6,191,500	0.06%
		米ドル買/円売 2017年8月	買建	120,000	13,241,304	13,240,800	0.12%
		香港ドル買/円売 2017年8 月	買建	96,000	1,356,470	1,355,520	0.01%
		シンガポール・ドル買/円 売 2017年8月	買建	45,000	3,682,471	3,658,650	0.03%
		ユーロ買/円売 2017年8月	買建	54,000	7,001,181	7,001,100	0.06%

(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29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	11,814,361,410	77.46
内 日本	11,814,361,410	77.46
地方債証券	1,131,824,900	7.42
内 日本	1,131,824,900	7.42
特殊債券	1,023,913,800	6.71
内 日本	1,023,913,800	6.71
社債券	1,126,040,600	7.38
内 日本	1,126,040,600	7.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	155,529,049	1.02
純資産総額	15,251,669,759	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

#### (2) 投資資産(平成29年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	156,000,000	104.84 163,558,200	104.27 162,664,320	0.600000 2024/06/20	1.07
2	338 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	103.51 157,343,560	103.05 156,639,040	0.400000 2025/03/20	1.03

3	116 5年国債	日本	国債証券	155,000,000	100.77 156,195,050	100.43 155,675,800	0.200000 2018/12/20	1.02
4	345 10年国債	日本	国債証券	155,000,000	100.38 155,601,010	100.42 155,651,000	0.100000 2026/12/20	1.02
5	126 5年国債	日本	国債証券	154,000,000	100.87 155,349,860	100.59 154,913,220	0.100000 2020/12/20	1.02
6	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.90 153,377,120	100.48 152,738,720	0.100000 2026/06/20	1.00
7	125 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,275,440	100.56 150,847,500	0.100000 2020/09/20	0.99
8	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	106.05 148,479,290	105.09 147,137,200	1.100000 2021/12/20	0.96
9	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	105.24 147,343,900	104.45 146,239,800	0.900000 2022/03/20	0.96
10	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.12 145,771,790	103.64 145,097,400	0.500000 2024/09/20	0.95
11	346 10年国債	日本	国債証券	143,000,000	100.67 143,969,200	100.33 143,477,620	0.100000 2027/03/20	0.94
12	325 10年国債	日本	国債証券	137,000,000	105.14 144,053,860	104.40 143,030,740	0.800000 2022/09/20	0.94
13	129 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.98 131,283,800	100.70 130,915,200	0.100000 2021/09/20	0.86
14	130 5年国債	日本	国債証券	127,000,000	101.12 128,434,060	100.72 127,920,750	0.100000 2021/12/20	0.84
15	373 2年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.80 126,000,000	100.33 125,423,750	0.100000 2019/02/15	0.82
16	371 2年国債	日本	国債証券	125,000,000	100.57 125,724,600	100.30 125,376,250	0.100000 2018/12/15	0.82
17	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	115.23 115,239,000	113.66 113,662,600	2.260000 2024/03/19	0.75
18	128 5年国債	日本	国債証券	107,000,000	100.93 108,000,620	100.66 107,707,270	0.100000 2021/06/20	0.71
19	331 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.52 107,658,810	103.90 107,020,090	0.600000 2023/09/20	0.70
20	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	104.36 107,495,950	103.42 106,525,690	1.100000 2020/06/20	0.70
21	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	104.94 104,942,400	104.15 104,155,800	1.084000 2021/09/17	0.68
22	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	105.07 105,078,000	104.00 104,001,000	1.300000 2020/06/20	0.68
23	36 地方公共団体	日本	特殊債券	100,000,000	104.47 104,477,000	103.95 103,953,200	0.892000 2022/05/27	0.68
24	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.58 104,582,400	103.94 103,942,800	0.800000 2022/11/25	0.68
25	24 - 16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.45 104,453,400	103.80 103,806,600	0.757000 2023/01/31	0.68
26	25 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.34 104,348,000	103.76 103,768,300	0.694000 2023/11/22	0.68
27	21 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.76 104,769,800	103.59 103,597,500	1.570000 2019/11/25	0.68

28	21 - 35 兵庫県公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.64 104,644,900	103.54 103,545,000	1.460000 2020/01/22	0.68
29	117 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	104.14 104,149,400	103.53 103,537,700	0.720000 2022/12/22	0.68
30	70 東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	104.02 104,025,400	103.53 103,533,900	1.193000 2020/09/29	0.68

(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	77.46%
地方債証券	7.42%
特殊債券	6.71%
社債券	7.38%
合計	98.98%

(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29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	160,418,884,229	98.59
内 ユーロ	65,652,891,749	40.35
内 シンガポール	640,436,973	0.39
内 マレーシア	689,944,005	0.42
内 ノルウェー	480,645,199	0.30
内 スウェーデン	781,496,688	0.48
内 デンマーク	1,004,182,022	0.62
内 イギリス	11,509,909,614	7.07
内 スイス	296,417,068	0.18
内 ポーランド	1,108,132,590	0.68
内 カナダ	3,399,356,114	2.09
内 アメリカ	68,998,433,350	42.40

内 メキシコ	1,425,334,228	0.88
内 南アフリカ	877,799,295	0.54
内 オーストラリア	3,553,905,334	2.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,302,154,267	1.41
純資産総額	162,721,038,496	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）	709,973,100	0.44
内 日本	709,973,100	0.44

(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29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	6,143,000	97.75 662,675,200	98.56 668,132,134	2.000000 2025/08/15	0.41
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.66 642,278,668	100.26 646,151,776	2.250000 2025/11/15	0.40
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.89 631,616,165	99.66 636,559,748	2.125000 2025/05/15	0.39
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,007,000	167.75 653,991,017	163.23 636,380,073	5.750000 2032/10/25	0.39
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.15 626,441,935	95.04 632,341,180	1.625000 2026/05/15	0.39
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.12 621,857,424	98.93 627,003,393	2.000000 2025/02/15	0.39
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	102.30 610,974,015	102.72 613,494,259	2.500000 2024/05/15	0.38
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	128.60 616,419,612	125.63 602,174,339	4.250000 2023/10/25	0.37
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	104.10 600,729,907	104.32 601,947,420	2.750000 2024/02/15	0.37
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	96.44 585,337,560	97.74 593,220,633	2.000000 2026/11/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	101.27 576,878,047	101.82 580,039,476	2.375000 2024/08/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	92.91 574,171,354	93.81 579,720,635	1.500000 2026/08/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	104.13 576,961,412	104.33 578,086,169	2.750000 2023/11/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.33 558,593,476	95.28 564,195,103	1.625000 2026/02/15	0.35

15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,734,000	162.54 576,170,260	156.98 556,468,076	4.500000 2041/04/25	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.23 553,019,025	100.35 553,686,642	2.125000 2024/03/31	0.34
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	117.09 551,086,400	114.87 540,612,106	3.000000 2022/04/25	0.33
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,709,000	158.93 558,210,935	153.58 539,406,517	4.750000 2035/04/25	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,824,000	150.35 550,483,113	145.25 531,806,149	4.000000 2038/10/25	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	117.13 539,099,609	114.80 528,375,610	3.250000 2021/10/25	0.32
21	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.88 535,151,078	140.62 519,412,101	6.000000 2031/05/01	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	103.77 516,341,396	103.35 514,241,658	2.625000 2020/11/15	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	155.02 527,206,742	150.49 511,801,483	5.500000 2029/04/25	0.31
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	98.00 506,649,955	98.80 510,806,552	1.750000 2023/05/15	0.31
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.56 516,236,008	124.79 509,008,394	3.500000 2026/04/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,280,000	106.86 504,730,703	105.50 498,274,390	3.625000 2020/02/15	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,380,000	113.54 497,591,021	110.90 486,000,181	3.500000 2020/04/25	0.30
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	117.95 493,959,563	115.35 483,063,181	3.750000 2021/04/25	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,350,000	99.69 478,555,341	100.41 482,009,793	2.000000 2023/02/15	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	107.89 485,274,762	106.93 480,988,296	3.625000 2021/02/15	0.30

(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	98.59%
合計	98.59%

(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 2017年9月	買建	256,000	22,517,069	22,451,200	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2017年9月	買建	182,000	16,106,134	16,083,340	0.01%
		ユーロ買/円売 2017年9月	買建	2,302,000	298,624,283	298,523,360	0.18%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2017年9月	買建	2,004,000	16,906,144	16,853,640	0.01%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2017年9月	買建	40,000	557,956	556,400	0.00%
		米ドル買/円売 2017年9月	買建	2,759,000	304,265,245	303,931,440	0.19%
		英ポンド買/円売 2017年9 月	買建	356,000	51,610,244	51,573,720	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。

[次へ](#)

## (参考情報) 運用実績

2017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	14,640円
純資産総額	34百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	3.5%
6カ月間	4.8%
1年間	15.1%
3年間	24.0%
5年間	115.0%
設定来	46.4%

※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	第9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	16年12月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	1,489	39.9%	日本円	60.3%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.3%
外国株式・先物	1,258	22.2%	米ドル	24.1%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
国内債券	282	11.9%	ユーロ	7.6%	修正デュレーション	日本電信電話	日本	0.7%
外国債券	758	9.8%	英ポンド	2.7%	残存年数	ソフトバンクグループ	日本	0.7%
国内リート・先物	59	8.1%	豪ドル	1.4%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.6%
外国リート	330	7.5%	カナダ・ドル	1.2%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.6%
外国投資信託等	6	0.0%	スイス・フラン	0.8%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			香港ドル	0.5%	A	野村不動産マスターF	日本	0.5%
			シンガポール・ドル	0.4%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.4%
コール・ローン、その他		1.3%	その他	1.0%	BB以下・無格付	ユニテッド・アーバン投資法人	日本	0.4%
合計	4,182	-	合計	100.0%	合計	合計		6.6%

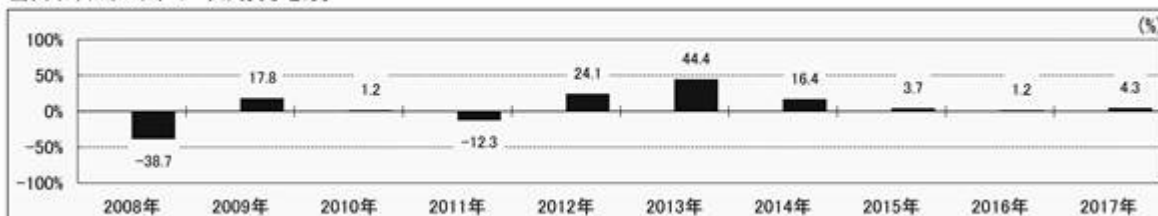
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.9%保有しております。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、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、2017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28年12月20日から平成29年6月19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29年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		127,452
親投資信託受益証券		33,307,597
流動資産合計		33,435,049
資産合計		33,435,049
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		4,974
未払委託者報酬		55,157
その他未払費用		1,146
流動負債合計		61,277
負債合計		61,277
純資産の部		
元本等		
元本	1	22,947,380
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		10,426,392
（分配準備積立金）		5,328,840
元本等合計		33,373,772
純資産合計		33,373,772
負債純資産合計		33,435,049

[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28年12月20日 至 平成29年6月19日 金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	985,960
営業収益合計	985,960
営業費用	
受託者報酬	4,974
委託者報酬	55,157
その他費用	1,146
営業費用合計	61,277
営業利益又は営業損失( )	924,683
経常利益又は経常損失( )	924,683
中間純利益又は中間純損失( )	924,683
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( )	3,907
期首剰余金又は期首欠損金( )	8,482,764
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,201,887
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,201,887
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,035
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	179,035
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,426,392

[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28年12月20日 至 平成29年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成29年6月19日現在
1. 1期首元本額	20,484,176円
期中追加設定元本額	2,895,754円
期中一部解約元本額	432,550円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	22,947,380口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19日
	該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成29年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成29年6月19日現在
	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	1.4544円

(1万口当たり純資産額)

(14,544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29年6月19日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,821,671,810
株式	3 4	130,788,548,700
派生商品評価勘定		12,633,700
未収入金		28,834,772
未収配当金		846,588,888
未収利息		444,991
その他未収収益	5	16,888,105
流動資産合計		142,515,610,966
資産合計		
142,515,610,966		
負債の部		
流動負債		
前受金		5,560,000
未払解約金		81,650,200
受入担保金		10,112,062,169
流動負債合計		10,199,272,369
負債合計		
10,199,272,369		
純資産の部		
元本等		
元本	1	134,015,527,208
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	1,699,188,611
元本等合計		132,316,338,597
純資産合計		
132,316,338,597		
負債純資産合計		
142,515,610,966		

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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29年6月19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28年12月20日 138,207,285,313円 8,228,105,305円 12,419,863,410円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	5,051,594,784円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	12,514,341,861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	65,626,694円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	104,147,960円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,717,168,842円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	82,994,802円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	2,616,740,959円
D-I's TOPIXイン デックス	33,133,141円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,669,532円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	573,610円
iFree TOPIXイン デックス	202,208,638円
iFree 8資産バランス	422,822,703円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,936,367,691円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,269,898,553円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,301,578,744円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,141,710,093円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,900,481,429円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	21,845,579円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	58,674,732円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,562,238円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	404,752円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	400,556円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	788,422円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	14,765,532円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	95,772,884円
	ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	35,417,495円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	935,329,931円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	202,925,998円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	12,437,050,347円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	332,322,209円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	516,570,023円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,054,630,854円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	158,236,001円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	266,976,479円
	ダイワ・ノーロード TOPI Xファンド	55,560,428円
	ダイワファンドラップ TOP IXインデックス	5,101,535,646円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	4,256,324円
	ダイワファンドラップオンラ イン TOPIXインデックス	506,699,360円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,150,598,678円
	ダイワライフスタイル25	190,817,109円
	ダイワライフスタイル50	640,205,929円
	ダイワライフスタイル75	509,632,026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)	15,321,487,640円
	計	134,015,527,208円
2.	期末日における受益権の総数	134,015,527,208口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,699,188,611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 9,741,474,750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 578,700,000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15,953,597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29年6月19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29年6月19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	1,511,115,000	-	1,523,800,000	12,685,000
合計	1,511,115,000	-	1,523,800,000	12,685,000

## (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。

- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9873円 (9,873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29年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		403,690,443
コール・ローン		180,298,945
株式		83,632,203,274
投資証券		2,239,266,910
派生商品評価勘定		1,394,669
未収入金		70,393,807
未収配当金		157,808,291
差入委託証拠金		629,656,126
流動資産合計		87,314,712,465
資産合計		87,314,712,465
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		138,993
未払金		123,453,682
未払解約金		68,878,300
流動負債合計		192,470,975
負債合計		192,470,975
純資産の部		
元本等		
元本	1	39,769,530,203
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		47,352,711,287
元本等合計		87,122,241,490
純資産合計		87,122,241,490
負債純資産合計		87,314,712,465

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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>(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29年6月19日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日
期首元本額	40,367,016,462円
期中追加設定元本額	2,959,145,482円
期中一部解約元本額	3,556,631,741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	606,253,637円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	23,451,318円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	333,234,264円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	37,203,103円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,181,410,595円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	310,155,879円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	793,782,115円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	128,229,593円
D-I's 外国株式インデックス	1,053,424円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	172,046円
iFree 外国株式インデックス	321,583,206円
iFree 8資産バランス	190,130,539円
DCダイワ外国株式インデックス	22,949,294,859円
ダイワ・ライフ・バランス30	512,142,357円
ダイワ・ライフ・バランス50	691,523,265円
ダイワ・ライフ・バランス70	535,942,934円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,449,210,387円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,591,322円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	15,926,850円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,482,441円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	89,936円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	178,417円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	4,364,859円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	43,371,488円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,245,591,297円
ダイワ世界バランスファンド60VA	450,481,667円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,179,996,247円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	201,888,567円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	436,539,279円

ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	27,079,001円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	465,705円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,937,182,549円
ダイワライフスタイル25	21,598,748円
ダイワライフスタイル50	72,453,747円
ダイワライフスタイル75	57,474,562円
計	39,769,530,203円
2. 期末日における受益権の総数	39,769,530,203口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	平成29年6月19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	1,213,457,973	-	1,214,612,685	1,154,712
合計	1,213,457,973	-	1,214,612,685	1,154,712

## (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。

- 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。
- 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。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	平成29年6月19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				
売 建	68,412,000	-	68,412,000	0
スイス・フラン	68,412,000	-	68,412,000	0
買 建	187,803,548	-	187,904,512	100,964
アメリカ・ドル	168,119,400	-	168,221,112	101,712
オーストラリア ・ドル	5,075,568	-	5,075,400	168
カナダ・ドル	8,395,470	-	8,395,000	470
ユーロ	6,213,110	-	6,213,000	110
合計	256,215,548	-	256,316,512	100,964

## (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29年6月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1907円 (21,907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29年6月19日現在
		金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,853,302,765
投資証券	2	262,677,393,500
未収入金		1,206,627,273
未収配当金		1,224,170,912
前払金		38,373,600
流動資産合計		267,999,868,050
資産合計		
267,999,868,050		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		32,103,744
未払解約金		612,497,200
流動負債合計		644,600,944
負債合計		644,600,944
純資産の部		
元本等		
元本	1	110,588,580,048
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		156,766,687,058
元本等合計		267,355,267,106
純資産合計		267,355,267,106
負債純資産合計		267,999,868,050

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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。 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  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、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29年6月19日現在
1.	1 期首	平成28年12月20日
	期首元本額	105,872,694,601円
	期中追加設定元本額	12,709,314,175円
	期中一部解約元本額	7,993,428,728円
	期末元本額の内訳	
	ファンド名	
	ダイワJ-REITオープン	10,417,625,084円
	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	94,154,372,341円
	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	402,333,441円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,838円
	iFree J-REITイン デックス	48,402,291円
	iFree 8資産バランス	172,489,875円
	DC・ダイワJ-REIT オープン	3,310,452,862円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,701,309円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,725,525円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,090,705円
	ダイワ・ノーロード J-RE ITファンド	56,096,983円
	ダイワファンドラップ J-R EITインデックス	505,579,118円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,419,971円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	89,792,438円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,419,475,267円
	計	110,588,580,048円
2.	期末日における受益権の総数	110,588,580,048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 352,800,000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29年6月19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29年6月19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	3,764,081,600	-	3,732,212,000	31,869,600
合計	3,764,081,600	-	3,732,212,000	31,869,600

## (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29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.4176円
(1万口当たり純資産額)	(24,176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29年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		121,519,313
コール・ローン		56,850,050
投資証券		10,455,356,583
派生商品評価勘定		164,564
未収入金		7,168,238
未収配当金		17,967,195
流動資産合計		10,659,025,943
資産合計		10,659,025,943
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		15,212
未払金		127,414,875
流動負債合計		127,430,087
負債合計		127,430,087
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,800,456,027
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,731,139,829
元本等合計		10,531,595,856
純資産合計		10,531,595,856
負債純資産合計		10,659,025,943

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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。 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。
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

	<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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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 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29年6月19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28年12月20日 2,861,359,942円 2,071,407,086円 132,311,001円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名 ダイワファンドラップ 外国R E I Tインデックス(為替 ヘッジあり) ダイワファンドラップ 外国R E I Tインデックス(為替 ヘッジなし) ダイワファンドラップオンラ イン 外国R E I Tインデック ス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンラ イン 外国R E I Tインデック ス(為替ヘッジなし) D - I ' s グローバルR E I Tインデックス D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050 i F r e e 外国R E I Tイン デックス i F r e e 8資産バランス D Cダイワ・グローバルR E I Tインデックスファンド D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020 D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030</p>	<p>2,449,658,136円 286,358,148円 84,607,724円 60,353,483円 1,195,511円 26,742円 55,173,095円 191,395,867円 1,340,562,963円 4,159,179円 6,461,836円</p>

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,077,486円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	288,555,660円
ダイワ・ノーロード グローバル REITファンド	21,634,931円
ダイワ外国REITインデック クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	4,663,299円
ダイワ外国REITインデック クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	4,571,967円
計	4,800,456,027円
2. 期末日における受益権の総数	4,800,456,027口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年6月19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29年6月19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	40,707,648	-	40,857,000	149,352
アメリカ・ドル	17,764,352	-	17,763,200	1,152
イギリス・ポ ンド	4,255,785	-	4,255,500	285
オーストラリア ・ドル	3,326,396	-	3,379,600	53,204
カナダ・ドル	4,970,034	-	5,034,000	63,966
シンガポール・ ドル	10,391,081	-	10,424,700	33,619
合計	40,707,648	-	40,857,000	149,352

(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29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.1939円
(1万口当たり純資産額)	(21,939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29年6月19日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		79,271,219
国債証券		12,021,443,940
地方債証券		1,234,474,200
特殊債券		1,024,356,600
社債券		1,126,571,000
未収利息		51,978,939
前払費用		1,296,755
流動資産合計		15,539,392,653
資産合計		15,539,392,653
負債の部		
流動負債		
未払解約金		24,194,000
流動負債合計		24,194,000
負債合計		24,194,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	12,253,761,469
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,261,437,184
元本等合計		15,515,198,653
純資産合計		15,515,198,653
負債純資産合計		15,539,392,653

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年6月19日現在
1. 1 期首 期首元本額	平成28年12月20日 11,776,318,682円

期中追加設定元本額	1,553,483,428円
期中一部解約元本額	1,076,040,641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	44,382円
iFree 日本債券インデッ クス	80,527,611円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	326,990,973円 4,827,791,095円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,369,173,172円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	735,708,417円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	543,305,719円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	446,250,857円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	133,637,311円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	70,477,530円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	47,250,410円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,133,916円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,780,991,032円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	231,904,426円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	256,192,353円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	400,382,265円
計	12,253,761,469円
2. 期末日における受益権の総数	12,253,761,469口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成29年6月19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29年6月19日現在
--------------

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	1.2662円
(1万口当たり純資産額)	(12,662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29年6月19日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	357,579,282
コール・ローン	246,072,186
国債証券	159,045,266,247
派生商品評価勘定	1,416,150
未収利息	1,218,676,602
前払費用	29,813,656
流動資産合計	160,898,824,123
資産合計	160,898,824,123
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,222
未払解約金	66,562,285
流動負債合計	66,582,507
負債合計	66,582,507
純資産の部	
元本等	
元本	1 59,492,198,258
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	101,340,043,358
元本等合計	160,832,241,616
純資産合計	160,832,241,616
負債純資産合計	160,898,824,123

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19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。 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29年6月19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28年12月20日 58,881,648,354円 3,386,778,224円 2,776,228,320円</p>
<p>期末元本額の内訳</p>	
<p>ファンド名</p>	
<p>ダイワ外国債券インデックス V A</p>	<p>1,108,659,184円</p>
<p>ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p>	<p>38,189,530円</p>
<p>ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)</p>	<p>269,683,265円</p>
<p>ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p>	<p>70,431,812円</p>
<p>ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)</p>	<p>959,053,375円</p>
<p>ダイワファンドラップ 外国債 券インデックス エマージン グプラス(為替ヘッジなし)</p>	<p>186,048,122円</p>
<p>ダイワファンドラップ 外国債 券インデックス(為替ヘジ なし)</p>	<p>527,373,808円</p>
<p>ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)</p>	<p>164,056,648円</p>
<p>D-I's 外国債券インデッ クス</p>	<p>868,793円</p>
<p>DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050</p>	<p>21,393円</p>
<p>iFree 外国債券インデッ クス</p>	<p>437,968,522円</p>

i F r e e 8 資産バランス	154,576,559円
D C ダイワ外国債券インデックス	38,801,331,058円
ダイワ・ライフ・バランス30	622,593,894円
ダイワ・ライフ・バランス50	280,025,629円
ダイワ・ライフ・バランス70	173,883,228円
D C ダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	256,463,334円
D C ダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	210,946,166円
D C ダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	63,176,090円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2020	13,340,120円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	18,915,572円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	1,227,961円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,175,849,022円
ダイワ世界バランスファンド60VA	182,272,592円
ダイワ・バランスファンド35VA	6,774,036,643円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	482,914,265円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	284,102,807円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	380,871,234円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	117,355,163円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	13,656,392円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	375,232円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,612,756,406円
ダイワライフスタイル25	34,979,224円
ダイワライフスタイル50	58,647,104円
ダイワライフスタイル75	15,548,111円
計	59,492,198,258円
2. 期末日における受益権の総数	59,492,198,258口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成29年6月19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29年6月19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	185,672,372	-	187,068,300	1,395,928
アメリカ・ドル	49,506,712	-	49,807,570	300,858
イギリス・ポンド	19,863,522	-	19,854,800	8,722
オーストラリア・ドル	13,992,093	-	14,365,000	372,907
カナダ・ドル	4,856,784	-	4,950,690	93,906
デンマーク・クローネ	1,665,518	-	1,671,000	5,482
ノルウェー・クローネ	524,081	-	525,200	1,119
ユーロ	81,672,315	-	82,018,200	345,885
南アフリカ・ランド	13,591,347	-	13,875,840	284,493
合計	185,672,372	-	187,068,300	1,395,928

#### (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29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.7034円
(1万口当たり純資産額)	(27,034円)

## 2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成29年7月31日

資産総額	34,194,659円
負債総額	54,440円
純資産総額（ - ）	34,140,219円
発行済数量	23,320,154口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4640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29年7月31日

資産総額	142,181,647,956円
負債総額	9,255,345,771円
純資産総額（ - ）	132,926,302,185円
発行済数量	133,307,220,564口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9971円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年7月31日

資産総額	88,378,725,221円
負債総額	205,070,010円
純資産総額（ - ）	88,173,655,211円
発行済数量	39,644,050,286口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2241円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年7月31日

資産総額	255,796,865,309円
負債総額	1,181,560,963円

純資産総額（ - ）	254,615,304,346円
発行済数量	106,587,139,613口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.3888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29年7月31日

資産総額	11,064,300,767円
負債総額	70,456,136円
純資産総額（ - ）	10,993,844,631円
発行済数量	5,041,814,008口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.1805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29年7月31日

資産総額	15,347,866,198円
負債総額	96,196,439円
純資産総額（ - ）	15,251,669,759円
発行済数量	12,072,016,444口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2634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29年7月31日

資産総額	162,904,988,118円
負債総額	183,949,622円
純資産総額（ - ）	162,721,038,496円
発行済数量	59,496,891,884口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.7350円

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

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

<訂正後>

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成29年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29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	77	206,007
追加型株式投資信託	692	13,838,117
株式投資信託 合計	769	14,044,124
単位型公社債投資信託	23	126,932
追加型公社債投資信託	14	2,074,451
公社債投資信託 合計	37	2,201,383
総合計	806	16,245,506

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

<訂正後>

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

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

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

(単位:百万円)

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

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

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

## (追加情報)



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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(平成28年3月31日)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

## （注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日）

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

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

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

当事業年度(平成29年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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



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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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。

## 当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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)	23,238	未払手数料	3,298
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)	768	未払費用	218
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)	1,036	長期差入保証金	1,028

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第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29年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成29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	60,000	（注2）
株式会社みずほ銀行	1,404,065	（注3）

（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。

（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

### 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29年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

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

<略>



## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年7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 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28年12月20日から平成29年6月19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29年6月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月20日から平成29年6月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。