

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成29年9月12日提出
【計算期間】	第10計算期間中 (自 平成28年12月20日 至 平成29年6月19日)
【ファンド名】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 1 【ファンドの運用状況】

## (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) 【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
----------------------------	-----

## (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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 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。

(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	ユナイテッド・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%

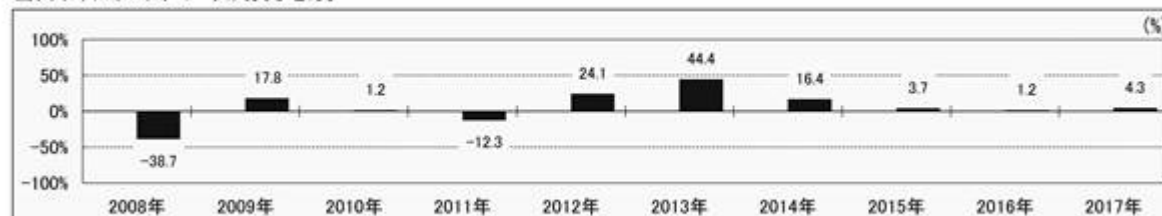
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.9%保有しております。

※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。

## 2 【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。

### 3 【ファンドの経理状況】

(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

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成28年12月19日現在	当中間計算期間末 平成29年6月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	96,687	127,452
親投資信託受益証券	28,917,637	33,307,597
流動資産合計	29,014,324	33,435,049
資産合計	29,014,324	33,435,049
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	3,837	4,974
未払委託者報酬	42,671	55,157
その他未払費用	876	1,146
流動負債合計	47,384	61,277
負債合計	47,384	61,277
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 20,484,176	1 22,947,380
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	8,482,764	10,426,392
( 分配準備積立金 )	5,432,973	5,328,840
元本等合計	28,966,940	33,373,772
純資産合計	28,966,940	33,373,772
負債純資産合計	29,014,324	33,435,049

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成27年12月19日 至 平成28年6月18日	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
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	2,654,730	985,960
<b>営業収益合計</b>	<b>2,654,730</b>	<b>985,960</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	4,528	4,974
委託者報酬	53,076	55,157
その他費用	751	1,146
<b>営業費用合計</b>	<b>58,355</b>	<b>61,277</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>2,713,085</b>	<b>924,683</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>2,713,085</b>	<b>924,683</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>2,713,085</b>	<b>924,683</b>
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	3,907
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>6,151,952</b>	<b>8,482,764</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>530,911</b>	<b>1,201,887</b>
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	1,201,887
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>194,551</b>	<b>179,035</b>
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	179,035
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>3,824,782</b>	<b>10,426,392</b>

## (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	前計算期間末 平成28年12月19日現在	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	16,118,592円	20,484,176円
期中追加設定元本額	5,468,224円	2,895,754円
期中一部解約元本額	1,102,640円	432,550円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	20,484,176口	22,947,380口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間 自 平成27年12月19日 至 平成28年6月18日	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。	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

前計算期間末 平成28年12月19日現在	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。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成28年12月19日現在	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 (1万口当たり純資産額)	1.4141円 (14,141円)	1.4544円 (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。

「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,184,602,845	10,821,671,810
株式 3 4	129,800,710,660	130,788,548,700
派生商品評価勘定	741,360	12,633,700

未収入金		481,730,228	28,834,772
未収配当金		11,051,750	846,588,888
未収利息		185,379	444,991
その他未収収益	5	2,380,925	16,888,105
流動資産合計		134,481,403,147	142,515,610,966
資産合計		134,481,403,147	142,515,610,966
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		42,160	-
前受金		960,000	5,560,000
未払解約金		370,015,000	81,650,200
受入担保金		3,898,160,805	10,112,062,169
流動負債合計		4,269,177,965	10,199,272,369
負債合計		4,269,177,965	10,199,272,369
純資産の部			
元本等			
元本	1	138,207,285,313	134,015,527,208
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	7,995,060,131	1,699,188,611
元本等合計		130,212,225,182	132,316,338,597
純資産合計		130,212,225,182	132,316,338,597
負債純資産合計		134,481,403,147	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



	<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、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。</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>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>
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12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	140,729,416,146円	138,207,285,313円
期中追加設定元本額	15,146,910,652円	8,228,105,305円
期中一部解約元本額	17,669,041,485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	5,497,265,486円	5,051,594,784円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	13,563,265,198円	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V A 2	126,601,870円	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)	141,686,038円	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)	2,316,749,433円	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)	96,793,829円	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)	3,260,080,900円	2,616,740,959円
D-I's TOPIXイン デックス	22,437,751円	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	27,594,657円	27,669,532円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	593,766円	573,610円
iFree TOPIXイン デックス	123,752,399円	202,208,638円
iFree 8資産バランス	117,889,334円	422,822,703円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,984,417,547円	60,936,367,691円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,349,453,806円	2,269,898,553円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,364,986,060円	2,301,578,744円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,111,458,667円	2,141,710,093円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,809,681,060円	3,900,481,429円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	22,874,733円	21,845,579円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	58,804,320円	58,674,732円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	12,636,946円	13,562,238円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	448,097円	404,752円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	440,730円	400,556円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	839,912円	788,422円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	63,672,333円	14,765,532円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	330,217,542円	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)	183,676,164円	35,417,495円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,412,992,315円	935,329,931円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	227,274,133円	202,925,998円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	14,178,232,373円	12,437,050,347円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	371,349,761円	332,322,209円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	639,321,646円	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)	1,159,873,390円	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)	162,562,702円	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)	285,231,730円	266,976,479円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	64,166,119円	55,560,428円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	1,792,053,724円	5,101,535,646円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	-円	4,256,324円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	-円	506,699,360円
ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,031,097,025円	1,150,598,678円
ダイワライフスタイル25	202,055,361円	190,817,109円
ダイワライフスタイル50	673,841,558円	640,205,929円
ダイワライフスタイル75	509,571,158円	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)	15,909,343,740円	15,321,487,640円
計	138,207,285,313円	134,015,527,208円
2. 期末日における受益権の総数	138,207,285,313口	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7,995,060,131円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,699,188,611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 3,737,943,250円	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 714,400,000円	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1,709,350円が含まれております。	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

	平成28年12月19日 現在	平成29年6月19日 現在
--	----------------	---------------

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	308,890,000	-	309,600,000	710,000	1,511,115,000	-	1,523,800,000	12,685,000
合計	308,890,000	-	309,600,000	710,000	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。

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12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	0.9422円	0.9873円
(1万口当たり純資産額)	(9,422円)	(9,873円)

## 「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	340,203,687	403,690,443
コール・ローン	153,142,293	180,298,945
株式	81,261,530,570	83,632,203,274
投資証券	2,095,626,412	2,239,266,910
派生商品評価勘定	822,838	1,394,669
未収入金	132,605,697	70,393,807

未収配当金	105,370,223	157,808,291
差入委託証拠金	582,058,178	629,656,126
流動資産合計	84,671,359,898	87,314,712,465
資産合計	84,671,359,898	87,314,712,465
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,064	138,993
未払金	-	123,453,682
未払解約金	227,130,000	68,878,300
流動負債合計	227,208,064	192,470,975
負債合計	227,208,064	192,470,975
純資産の部		
元本等		
元本	1 40,367,016,462	39,769,530,203
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,077,135,372	47,352,711,287
元本等合計	84,444,151,834	87,122,241,490
純資産合計	84,444,151,834	87,122,241,490
負債純資産合計	84,671,359,898	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> <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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<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>
<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>	<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12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	38,798,220,086円	40,367,016,462円
期中追加設定元本額	5,148,416,668円	2,959,145,482円
期中一部解約元本額	3,579,620,292円	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 V A	713,025,920円	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)	32,240,774円	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)	453,992,902円	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)	43,993,709円	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)	1,490,582,674円	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)	118,469,160円	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)	218,819,187円	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 エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	- 円	128,229,593円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,689,699円	1,053,424円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	182,021円	172,046円
i F r e e 外国株式イン デックス	207,132,402円	321,583,206円
i F r e e 8資産バランス	53,397,250円	190,130,539円



DCダイワ外国株式インデックス	22,403,108,724円	22,949,294,859円
ダイワ・ライフ・バランス30	544,438,422円	512,142,357円
ダイワ・ライフ・バランス50	725,810,195円	691,523,265円
ダイワ・ライフ・バランス70	538,721,875円	535,942,934円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,464,751,026円	1,449,210,387円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	7,245,662円	6,591,322円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	14,997,798円	15,926,850円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,621,406円	3,482,441円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	100,000円	89,936円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	197,107円	178,417円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	19,292,523円	4,364,859円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	150,605,980円	43,371,488円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,943,779,185円	1,245,591,297円
ダイワ世界バランスファンド60VA	521,063,437円	450,481,667円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,894,517,852円	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)	227,433,106円	201,888,567円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	391,241,366円	436,539,279円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	23,106,461円	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)	- 円	465,705円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,000,082,219円	2,937,182,549円

ダイワライフスタイル25	23,116,958円	21,598,748円
ダイワライフスタイル50	77,484,135円	72,453,747円
ダイワライフスタイル75	58,775,327円	57,474,562円
計	40,367,016,462円	39,769,530,203円
2. 期末日における受益権の総数	40,367,016,462口	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28年12月19日 現在				平成29年6月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838	1,213,457,973	-	1,214,612,685	1,154,712
合計	1,060,857,918	-	1,061,163,756	305,838	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。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	平成28年12月19日 現在				平成29年6月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	135,974,736	-	135,535,800	438,936	68,412,000	-	68,412,000	0
アメリカ・ドル	111,079,800	-	110,562,800	517,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	24,894,936	-	24,973,000	78,064	-	-	-	-
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	135,974,736	-	135,535,800	438,936	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.0919円	2.1907円
(1万口当たり純資産額)	(20,919円)	(21,907円)

「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,972,263,132	2,853,302,765
投資証券	2 255,690,211,900	262,677,393,500
派生商品評価勘定	20,425,856	-
未収入金	-	1,206,627,273
未収配当金	1,045,322,377	1,224,170,912
前払金	-	38,373,600
流動資産合計	261,728,223,265	267,999,868,050
資産合計	261,728,223,265	267,999,868,050
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	-	32,103,744
前受金	19,071,800	-
未払金	3,138,607,753	-
未払解約金	18,444,000	612,497,200
流動負債合計	3,176,123,553	644,600,944
負債合計	3,176,123,553	644,600,944
純資産の部		
元本等		
元本	1	105,872,694,601
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	152,679,405,111	156,766,687,058
元本等合計	258,552,099,712	267,355,267,106
純資産合計	258,552,099,712	267,355,267,106
負債純資産合計	261,728,223,265	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	<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。</p> <p>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。</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>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>
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12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	89,610,737,405円	105,872,694,601円
期中追加設定元本額	24,593,354,604円	12,709,314,175円
期中一部解約元本額	8,331,397,408円	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	9,781,847,232円	10,417,625,084円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	90,876,052,371円	94,154,372,341円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	426,116,567円	402,333,441円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	18,797円	22,838円
iFree J-REITイ ンデックス	33,242,209円	48,402,291円
iFree 8資産バランス	45,191,617円	172,489,875円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,226,297,529円	3,310,452,862円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,357,905円	3,701,309円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,855,028円	5,725,525円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	900,684円	1,090,705円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	51,513,007円	56,096,983円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	188,297,819円	505,579,118円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	- 円	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	- 円	89,792,438円
ダイワ・インデックスセレク ト J-REIT	1,235,003,836円	1,419,475,267円
計	105,872,694,601円	110,588,580,048円

2.	期末日における受益権の総数	105,872,694,601口	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 377,400,000円	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28年12月19日 現在			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)	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	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800	3,764,081,600	-	3,732,212,000	31,869,600

合計	2,667,788,200	-	2,688,378,000	20,589,800	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.4421円	2.4176円
(1万口当たり純資産額)	(24,421円)	(24,176円)

## 「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	302,428,959	121,519,313
コール・ローン	92,651,825	56,850,050
投資証券	6,092,393,296	10,455,356,583
派生商品評価勘定	-	164,564
未収入金	1,401	7,168,238
未収配当金	11,121,665	17,967,195
流動資産合計	6,498,597,146	10,659,025,943
資産合計	6,498,597,146	10,659,025,943
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,100	15,212
未払金	307,456,138	127,414,875
未払解約金	10,011,000	-
流動負債合計	317,473,238	127,430,087



負債合計		317,473,238	127,430,087
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,861,359,942	4,800,456,027
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,319,763,966	5,731,139,829
元本等合計		6,181,123,908	10,531,595,856
純資産合計		6,181,123,908	10,531,595,856
負債純資産合計		6,498,597,146	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	<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。</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	受取配当金

	<p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>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>	<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12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	1,288,622,228円	2,861,359,942円
期中追加設定元本額	1,695,507,019円	2,071,407,086円
期中一部解約元本額	122,769,305円	132,311,001円
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	1,071,680,040円	2,449,658,136円
REIT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	109,360,983円	286,358,148円
REIT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	- 円	84,607,724円
イン 外国REIT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	- 円	60,353,483円
イン 外国REITインデッ		
クス(為替ヘッジなし)		
D-I's グローバルREI	1,488,344円	1,195,511円
Tインデックス		
DCダイワ・ターゲットイ	23,511円	26,742円
ヤー2050		

iFree 外国REITインデックス	45,690,995円	55,173,095円
iFree 8資産バランス	51,307,248円	191,395,867円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	1,275,948,091円	1,340,562,963円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,847,988円	4,159,179円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	5,708,895円	6,461,836円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	946,555円	1,077,486円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	278,156,453円	288,555,660円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	17,200,839円	21,634,931円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	- 円	4,663,299円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	- 円	4,571,967円
計	2,861,359,942円	4,800,456,027円
2. 期末日における受益権の総数	2,861,359,942口	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28年12月19日 現在				平成29年6月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	78,779,958	-	78,773,858	6,100	40,707,648	-	40,857,000	149,352
アメリカ・ドル	52,932,825	-	52,929,000	3,825	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	1,675,511	-	1,675,420	91	4,970,034	-	5,034,000	63,966
シンガポ ー ル・ドル	4,399,180	-	4,398,840	340	10,391,081	-	10,424,700	33,619
ユーロ	17,196,993	-	17,196,798	195	-	-	-	-
香港・ドル	2,575,449	-	2,573,800	1,649	-	-	-	-
合計	78,779,958	-	78,773,858	6,100	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.1602円	2.1939円
(1万口当たり純資産額)	(21,602円)	(21,939円)

「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	84,027,735	79,271,219
国債証券	11,610,339,360	12,021,443,940
地方債証券	1,235,850,800	1,234,474,200
特殊債証券	1,029,950,700	1,024,356,600
社債券	916,698,400	1,126,571,000
未収入金	105,201,200	-
未収利息	52,041,502	51,978,939
前払費用	1,193,873	1,296,755
流動資産合計	15,035,303,570	15,539,392,653
資産合計	15,035,303,570	15,539,392,653
負債の部		
流動負債		
未払金	104,477,000	-
未払解約金	33,763,707	24,194,000
流動負債合計	138,240,707	24,194,000
負債合計	138,240,707	24,194,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 11,776,318,682	12,253,761,469

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,120,744,181	3,261,437,184
元本等合計	14,897,062,863	15,515,198,653
純資産合計	14,897,062,863	15,515,198,653
負債純資産合計	15,035,303,570	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	12,066,650,337円	11,776,318,682円
期中追加設定元本額	1,822,199,066円	1,553,483,428円
期中一部解約元本額	2,112,530,721円	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	34,845円	44,382円
iFree 日本債券インデックス	43,708,353円	80,527,611円
iFree 8資産バランス	87,248,594円	326,990,973円
ダイワ・ライフ・バランス30	4,310,465,771円	4,827,791,095円

ダイワ・ライフ・バランス50	2,079,954,504円	2,369,173,172円
ダイワ・ライフ・バランス70	662,333,867円	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)	508,103,224円	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)	413,870,204円	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)	120,775,083円	133,637,311円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	62,143,213円	70,477,530円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	38,460,348円	47,250,410円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	2,109,162円	3,133,916円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,476,281,789円	1,780,991,032円
ダイワ世界バランスファンド60VA	238,982,327円	231,904,426円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	271,158,712円	256,192,353円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	460,688,686円	400,382,265円
計	11,776,318,682円	12,253,761,469円
2. 期末日における受益権の総数	11,776,318,682口	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	1.2650円	1.2662円
(1万口当たり純資産額)	(12,650円)	(12,662円)

「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12月19日現在	平成29年6月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	305,109,849	357,579,282
コール・ローン	406,948,440	246,072,186
国債証券	157,499,588,611	159,045,266,247
派生商品評価勘定	12,516,966	1,416,150
未収利息	1,215,567,069	1,218,676,602
前払費用	30,994,874	29,813,656
流動資産合計	159,470,725,809	160,898,824,123
資産合計	159,470,725,809	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	169,556,883	66,562,285
流動負債合計	169,556,883	66,582,507
負債合計	169,556,883	66,582,507
純資産の部		
元本等		
元本	1	58,881,648,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	100,419,520,572	101,340,043,358



元本等合計	159,301,168,926	160,832,241,616
純資産合計	159,301,168,926	160,832,241,616
負債純資産合計	159,470,725,809	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。</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）、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。</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>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. 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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1. 1 期首	平成27年12月19日	平成28年12月20日
期首元本額	57,214,334,756円	58,881,648,354円
期中追加設定元本額	5,154,067,833円	3,386,778,224円
期中一部解約元本額	3,486,754,235円	2,776,228,320円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	1,415,320,560円	1,108,659,184円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	47,463,120円	38,189,530円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	337,557,046円	269,683,265円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	78,887,258円	70,431,812円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,120,399,794円	959,053,375円
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)	61,945,238円	186,048,122円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘ ッジなし)	128,166,415円	527,373,808円

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)	- 円	164,056,648円
D-I's 外国債券インデックス	850,783円	868,793円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	17,978円	21,393円
iFree 外国債券イン デックス	78,031,637円	437,968,522円
iFree 8資産バランス	41,183,907円	154,576,559円
DCダイワ外国債券インデ ックス	37,918,206,213円	38,801,331,058円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	586,993,041円	622,593,894円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	260,230,135円	280,025,629円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	160,681,582円	173,883,228円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	251,367,408円	256,463,334円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	201,924,480円	210,946,166円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	60,112,470円	63,176,090円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	12,290,657円	13,340,120円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	15,684,745円	18,915,572円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	932,613円	1,227,961円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,682,564,879円	1,175,849,022円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	193,317,673円	182,272,592円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	7,166,577,248円	6,774,036,643円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	519,632,367円	482,914,265円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	334,968,931円	284,102,807円

ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	393,370,357円	380,871,234円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	103,674,791円	117,355,163円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	8,299,785円	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)	- 円	375,232円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,596,721,299円	5,612,756,406円
ダイワライフスタイル25	34,708,067円	34,979,224円
ダイワライフスタイル50	55,186,341円	58,647,104円
ダイワライフスタイル75	14,379,536円	15,548,111円
計	58,881,648,354円	59,492,198,258円
2. 期末日における受益権の総数	58,881,648,354口	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

	平成28年12月19日 現在	平成29年6月19日 現在
--	----------------	---------------

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966	185,672,372	-	187,068,300	1,395,928
アメリカ・ドル	210,905,918	-	220,040,040	9,134,122	49,506,712	-	49,807,570	300,858
イギリス・ポンド	8,712,427	-	9,103,460	391,033	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	10,550,171	-	11,101,860	551,689	4,856,784	-	4,950,690	93,906
シンガポール・ドル	2,763,722	-	2,847,250	83,528	-	-	-	-
スイス・フラン	1,669,693	-	1,719,900	50,207	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	3,224,261	-	3,308,540	84,279	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	4,979,808	-	5,113,950	134,142	1,665,518	-	1,671,000	5,482
ノルウェー・クローネ	1,884,240	-	1,939,080	54,840	524,081	-	525,200	1,119
ポーランド・ズロチ	3,985,788	-	4,104,040	118,252	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	6,030,456	-	6,377,490	347,034	-	-	-	-
ユーロ	66,843,880	-	68,276,100	1,432,220	81,672,315	-	82,018,200	345,885
南アフリカ・ランド	3,578,950	-	3,714,570	135,620	13,591,347	-	13,875,840	284,493
合計	325,129,314	-	337,646,280	12,516,966	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28年12月19日現在	平成29年6月19日現在
1口当たり純資産額	2.7054円	2.7034円
(1万口当たり純資産額)	(27,054円)	(27,034円)

## 4 【委託会社等の概況】

## (1) 【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年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

## (2) 【事業の内容及び営業の状況】

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) 【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。

## 5 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(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	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
<b>利益剰余金</b>		
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 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	120	122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

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

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

法定実効税率 (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。

**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。

## 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。