

【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30年9月11日提出
【計算期間】	第11計算期間中 (自 平成29年12月19日 至 平成30年6月18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】	高橋 慎
【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】	003-5555-3431
【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】 (2018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	43,003,505	99.80
内 日本	43,003,505	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	84,141	0.20
純資産総額	43,087,646	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 (2008年12月18日)	681,848	681,848	0.6054	0.6054
第2計算期間末 (2009年12月18日)	1,176,672	1,176,672	0.6991	0.6991
第3計算期間末 (2010年12月20日)	952,605	952,605	0.7319	0.7319
第4計算期間末 (2011年12月19日)	1,354,908	1,354,908	0.6293	0.6293
第5計算期間末 (2012年12月18日)	3,373,491	3,373,491	0.7645	0.7645
第6計算期間末 (2013年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (2014年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
第8計算期間末 (2015年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
第9計算期間末 (2016年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
2017年7月末日	34,140,219	-	1.4640	-
8月末日	31,960,484	-	1.4633	-
9月末日	32,267,822	-	1.5056	-

10月末日	33,321,758	-	1.5438	-
11月末日	36,527,554	-	1.5614	-
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802
12月末日	37,984,804	-	1.5860	-
2018年1月末日	39,426,614	-	1.5902	-
2月末日	39,148,843	-	1.5367	-
3月末日	39,991,320	-	1.5110	-
4月末日	41,192,550	-	1.5540	-
5月末日	42,463,326	-	1.5466	-
6月末日	41,692,328	-	1.5534	-
7月末日	43,087,646	-	1.5760	-

【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
第10計算期間	0.0000
2017年12月19日～ 2018年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	39.5
第2計算期間	15.5
第3計算期間	4.7
第4計算期間	14.0
第5計算期間	21.5
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9

第8計算期間	6.5
第9計算期間	2.3
第10計算期間	11.7
2017年12月19日～ 2018年6月18日	0.6

(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 (2018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	144,508,241,850	99.26
内 日本	144,508,241,850	99.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,073,364,392	0.74
純資産総額	145,581,606,242	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)	996,360,000	0.68
内 日本	996,360,000	0.68

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

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2018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	101,403,774,909	96.08
内 香港	1,394,047,294	1.32
内 シンガポール	474,450,111	0.45
内 イスラエル	216,577,061	0.21

内 ノルウェー	293,220,145	0.28
内 スウェーデン	1,087,711,997	1.03
内 デンマーク	711,282,204	0.67
内 イギリス	7,157,822,038	6.78
内 アイルランド	220,112,503	0.21
内 オランダ	1,499,802,924	1.42
内 ベルギー	442,952,353	0.42
内 フランス	4,411,843,129	4.18
内 ドイツ	3,995,147,118	3.79
内 スイス	3,340,841,465	3.17
内 ポルトガル	62,174,916	0.06
内 スペイン	1,263,379,124	1.20
内 イタリア	984,844,343	0.93
内 フィンランド	420,573,015	0.40
内 オーストリア	95,643,486	0.09
内 カナダ	3,936,173,558	3.73
内 アメリカ	66,769,498,254	63.26
内 オーストラリア	2,542,869,879	2.41
内 ニュージーランド	82,807,992	0.08
投資証券	2,583,412,882	2.45
内 香港	81,723,756	0.08
内 シンガポール	43,291,891	0.04
内 イギリス	86,306,079	0.08
内 フランス	152,168,039	0.14
内 カナダ	18,408,985	0.02
内 アメリカ	1,905,960,127	1.81
内 オーストラリア	295,554,005	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,555,653,531	1.47
純資産総額	105,542,841,322	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)	1,633,741,108	1.55
内 アメリカ	1,633,741,108	1.55
為替予約取引(買建)	443,800,000	0.42
内 日本	443,800,000	0.42

(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 (2018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	210,473,631,250	97.56
内 日本	210,473,631,250	97.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,267,402,809	2.44
純資産総額	215,741,034,059	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)	3,164,400,000	1.47
内 日本	3,164,400,000	1.47

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

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

(注3) 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 (2018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	169,979,622	0.98
内 アメリカ	169,979,622	0.98
投資証券	16,830,814,097	97.41
内 ガーンジー	10,275,329	0.06
内 マン島	8,860,030	0.05
内 香港	379,301,823	2.20

内 シンガポール	601,167,073	3.48
内 イスラエル	4,001,835	0.02
内 イギリス	946,682,806	5.48
内 アイルランド	41,471,616	0.24
内 オランダ	73,977,159	0.43
内 ベルギー	137,400,300	0.80
内 フランス	868,718,100	5.03
内 ドイツ	46,480,950	0.27
内 スペイン	141,835,727	0.82
内 イタリア	18,222,169	0.11
内 カナダ	306,529,569	1.77
内 アメリカ	11,994,524,977	69.42
内 オーストラリア	1,178,912,392	6.82
内 ニュージーランド	72,452,242	0.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	278,385,894	1.61
純資産総額	17,279,179,613	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)	167,238,019	0.97
内 ドイツ	23,322,435	0.13
内 アメリカ	143,915,584	0.83
為替予約取引(買建)	102,669,600	0.59
内 日本	102,669,600	0.59

(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 (2018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	12,834,338,940	78.26
内 日本	12,834,338,940	78.26
地方債証券	1,140,268,300	6.95
内 日本	1,140,268,300	6.95

特殊債券		918,496,500	5.60
	内 日本	918,496,500	5.60
社債券		1,345,129,700	8.20
	内 日本	1,345,129,700	8.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		160,625,592	0.98
純資産総額		16,398,859,032	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 (2018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	163,757,821,595	98.17
内 ユーロ	66,438,498,519	39.83
内 シンガポール	615,143,217	0.37
内 マレーシア	784,651,131	0.47
内 ノルウェー	373,224,049	0.22
内 スウェーデン	631,268,057	0.38
内 デンマーク	974,971,244	0.58
内 イギリス	11,415,203,883	6.84
内 スイス	214,612,191	0.13
内 ポーランド	1,048,236,341	0.63
内 カナダ	3,308,001,228	1.98
内 アメリカ	72,081,666,390	43.21
内 メキシコ	1,364,085,371	0.82
内 南アフリカ	986,030,748	0.59
内 オーストラリア	3,522,229,226	2.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,047,326,295	1.83
純資産総額	166,805,147,890	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,108,045,570	0.66
	内 日本	1,108,045,570
為替予約取引(売建)	20,805,740	0.01

内 日本	20,805,740	0.01
------	------------	------

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

(注2) 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。

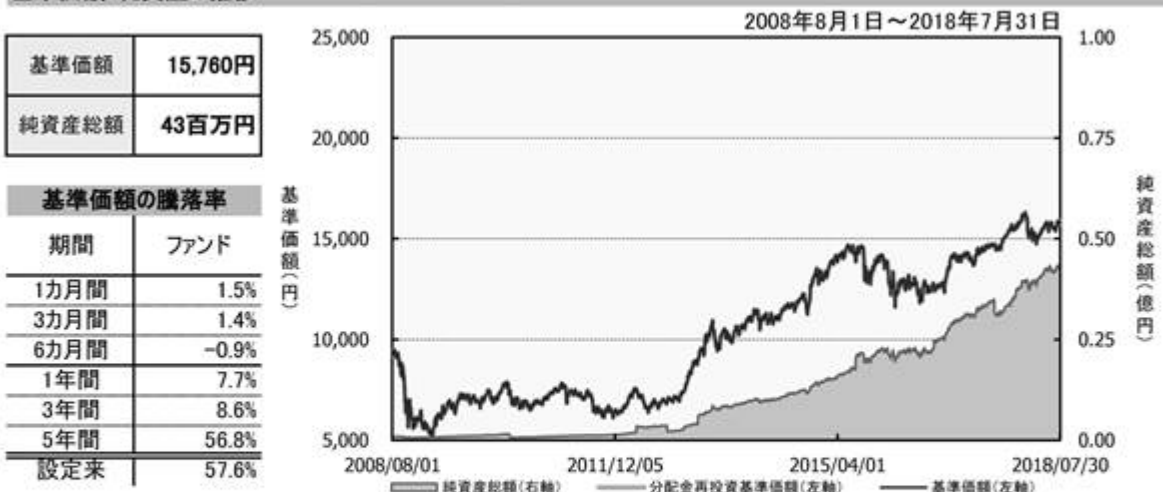
(参考情報) 運用実績

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2040

2018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



※上記の「基準価額の騰落率」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	第10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	17年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	1,499	37.8%	日本円	59.6%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.3%
外国株式・先物	1,251	21.9%	米ドル	24.8%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%
国内債券	272	13.6%	ユーロ	7.9%	修正デュレーション	ソフトバンクグループ	日本	0.6%
外国債券	766	10.7%	英ポンド	2.7%	残存年数	ソニー	日本	0.6%
国内リート・先物	60	7.9%	豪ドル	1.3%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	0.6%
外国リート・先物	318	7.4%	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	7	0.1%	スイス・フラン	0.7%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
			香港ドル	0.5%	A	野村不動産マスターF	日本	0.4%
			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		1.4%	その他	0.9%	BB以下・無格付	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
合計	4,173	-	合計	100.0%	合計	合計		6.0%

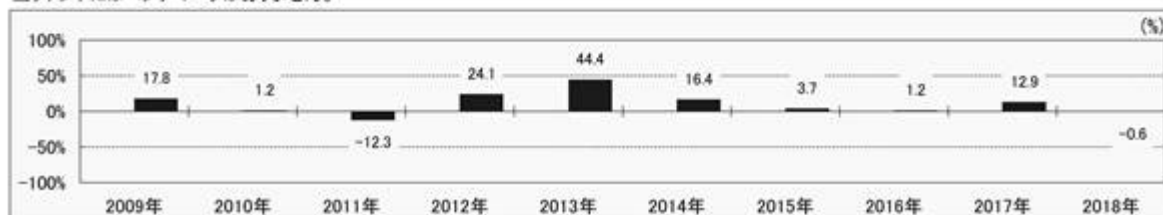
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.2%保有しております。

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2018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
第10計算期間	7,259,647	3,856,478
2017年12月19日～ 2018年6月18日	3,704,011	766,857

(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29年12月19日から平成30年6月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成29年12月18日現在	当中間計算期間末 平成30年6月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	50,567
コール・ローン	135,817	110,081
親投資信託受益証券	37,677,566	42,057,815
流動資産合計	37,813,383	42,218,463
資産合計	37,813,383	42,218,463
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,381	6,425
未払委託者報酬	59,850	71,060
その他未払費用	1,269	1,518
流動負債合計	66,500	79,003
負債合計	66,500	79,003
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,887,345	1 26,824,499
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,859,538	15,314,961
（分配準備積立金）	8,101,051	7,872,019
元本等合計	37,746,883	42,139,460
純資産合計	37,746,883	42,139,460
負債純資産合計	37,813,383	42,218,463

(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28年12月20日 至 平成29年6月19日	当中間計算期間 自 平成29年12月19日 至 平成30年6月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	985,960	53,751
営業収益合計	985,960	53,751
営業費用		
受託者報酬	4,974	6,425
委託者報酬	55,157	71,060
その他費用	1,146	1,518
営業費用合計	61,277	79,003
営業利益又は営業損失（ ）	924,683	132,754
経常利益又は経常損失（ ）	924,683	132,754
中間純利益又は中間純損失（ ）	924,683	132,754
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	3,907	2,655
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,482,764	13,859,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,201,887	2,032,962
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	2,032,962
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,035	442,130
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	442,130
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,426,392	15,314,961

(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29年12月19日	至 平成30年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首元本額	20,484,176円	23,887,345円
期中追加設定元本額	7,259,647円	3,704,011円
期中一部解約元本額	3,856,478円	766,857円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	23,887,345口	26,824,499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	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	自 平成29年12月19日 至 平成30年6月18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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 平成29年12月18日現在	当中間計算期間末 平成30年6月18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29年12月18日現在	当中間計算期間末 平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5802円 (15,802円)	1,5709円 (15,709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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,405,565,961
コール・ローン	5,325,669,538	7,413,719,604

株式	2 3	143,644,364,120	143,338,626,920
派生商品評価勘定		20,448,280	-
未収入金		28,787,680	4,869,533
未収配当金		13,410,638	930,001,240
未収利息		203,658	451,675
その他未収収益	4	2,465,912	17,235,087
流動資産合計		149,035,349,826	155,110,470,020
資産合計		149,035,349,826	155,110,470,020
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	19,583,460
前受金		3,005,000	270,000
未払金		-	693,118,919
未払解約金		146,171,100	72,807,900
受入担保金		3,932,576,602	9,176,946,135
その他未払費用		-	146,531
流動負債合計		4,081,752,702	9,962,872,945
負債合計		4,081,752,702	9,962,872,945
純資産の部			
元本等			
元本	1	128,399,557,544	130,428,818,246
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		16,554,039,580	14,718,778,829
元本等合計		144,953,597,124	145,147,597,075
純資産合計		144,953,597,124	145,147,597,075
負債純資産合計		149,035,349,826	155,110,470,020

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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)新株予約権証券</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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	138,207,285,313円	128,399,557,544円
期中追加設定元本額	15,341,862,921円	9,131,255,059円
期中一部解約元本額	25,149,590,690円	7,101,994,357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	4,340,213,526円	4,152,912,004円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	10,950,187,562円	9,718,504,606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	62,130,624円	61,170,480円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	80,019,243円	71,040,156円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,368,511,576円	1,165,714,659円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,073,352円	59,978,575円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,923,003,980円	1,595,237,470円
D-I's TOPIXイン デックス	28,362,087円	27,076,578円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	24,808,577円	21,813,789円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	571,628円	637,974円
iFree TOPIXイン デックス	276,190,632円	505,006,837円
iFree 8資産バランス	638,889,399円	889,206,014円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,774,772,193円	62,922,582,860円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,165,831,652円	2,334,930,943円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,314,028,426円	2,510,392,046円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,187,409,592円	2,440,855,600円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,029,488,955円	4,403,802,944円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	16,986,957円	14,753,126円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,136,828円	48,545,108円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,388,722円	14,282,313円

ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	364,602円	334,996円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	362,318円	343,410円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	690,983円	684,622円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	6,930,943円	2,185,320円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	17,156,249円	4,842,830円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	15,921,448円	10,343,078円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	345,195,537円	234,779,386円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	169,150,600円	164,962,864円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	10,851,915,853円	9,949,417,954円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	220,121,595円	48,616,584円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	228,337,957円	37,979,271円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	885,899,660円	856,720,435円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	144,200,065円	129,181,252円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	241,089,158円	225,110,840円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	73,865,612円	103,399,957円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	6,118,126,552円	7,611,662,973円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	4,248,902円	88,676,383円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	1,205,509,199円	1,721,014,002円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,197,963,794円	1,348,705,621円

	ダイワライフスタイル25	175,105,430円	174,040,116円
	ダイワライフスタイル50	625,654,835円	615,588,461円
	ダイワライフスタイル75	504,751,457円	519,964,237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）	14,050,989,284円	13,621,819,572円
計		128,399,557,544円	130,428,818,246円
2.	期末日における受益権の総数	128,399,557,544口	130,428,818,246口
3.	2 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 3,768,357,250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 8,656,436,600円
4.	3 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 716,200,000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 753,000,000円
5.	4 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1,725,920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16,256,952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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18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	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000	1,768,860,000	-	1,749,330,000	19,530,000
合計	1,214,735,000	-	1,235,220,000	20,485,000	1,768,860,000	-	1,749,330,000	19,530,000

(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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.1289円	1.1128円
(1万口当たり純資産額)	(11,289円)	(11,128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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		405,471,667	667,490,000
金銭信託		-	62,857,312
コール・ローン		189,200,610	136,836,724
株式		92,687,655,335	99,028,281,161
投資証券		2,529,090,313	2,484,567,453
派生商品評価勘定		13,640,211	1,139,589
未収入金		1,128,731	604,133
未収配当金		123,218,810	182,956,468
差入委託証拠金		752,492,066	795,716,344
流動資産合計		96,701,897,743	103,360,449,184
資産合計		96,701,897,743	103,360,449,184
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		498,240	1,299,198
未払金		-	39,373,894
未払解約金		72,256,900	65,240,500
その他未払費用		-	4,309
流動負債合計		72,755,140	105,917,901
負債合計		72,755,140	105,917,901
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,738,227,827	41,796,030,432
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		56,890,914,776	61,458,500,851
元本等合計		96,629,142,603	103,254,531,283
純資産合計		96,629,142,603	103,254,531,283
負債純資産合計		96,701,897,743	103,360,449,184

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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、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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	40,367,016,462円	39,738,227,827円
期中追加設定元本額	5,794,523,705円	3,825,962,688円
期中一部解約元本額	6,423,312,340円	1,768,160,083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	561,940,757円	518,834,432円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	18,626,936円	16,429,883円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	270,075,076円	228,462,733円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,623,332円	27,312,346円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	888,111,878円	727,475,955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)	413,513,055円	547,424,957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)	927,597,200円	1,332,544,707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)	311,112,761円	488,810,724円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,828,241円	1,010,751円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	175,432円	195,844円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	392,436,479円	536,742,294円
i F r e e 8資産バランス	294,049,882円	405,411,266円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	24,119,249,594円	25,708,934,630円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	497,058,709円	542,582,707円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	709,194,443円	767,007,247円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	561,812,076円	622,100,357円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,434,214,433円	1,467,586,997円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	5,218,402円	4,277,573円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,136,612円	12,987,127円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,584,603円	3,783,334円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	81,383円	76,716円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	162,594円	157,568円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	2,143,628円	668,959円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	7,922,722円	2,223,951円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	485,331,409円	323,855,425円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	393,970,223円	378,861,282円

ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,763,739,239円	3,419,057,893円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	176,212,362円	168,314,746円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	502,490,994円	592,138,249円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	44,779,107円	62,228,321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)	464,604円	454,673円
ダイワ投信倶楽部外国株式 インデックス	2,754,344,985円	2,737,758,055円
ダイワライフスタイル25	20,386,271円	19,963,541円
ダイワライフスタイル50	71,290,918円	70,913,871円
ダイワライフスタイル75	58,347,487円	59,441,318円
計	39,738,227,827円	41,796,030,432円
2. 期末日における受益権の総数	39,738,227,827口	41,796,030,432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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

	平成29年12月18日 現在	平成30年6月18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	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711	1,602,280,927	-	1,600,987,258	1,293,669
合計	1,377,511,961	-	1,391,142,672	13,630,711	1,602,280,927	-	1,600,987,258	1,293,669

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	124,227,740	-	123,739,000	488,740	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060
アメリカ・ドル	124,227,740	-	123,739,000	488,740	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060
合計	124,227,740	-	123,739,000	488,740	98,243,940	-	99,378,000	1,134,060

(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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2,4316円	2,4704円
(1万口当たり純資産額)	(24,316円)	(24,704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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	741,584,852
コール・ローン	1,059,519,229	1,614,387,219
投資証券 2	217,100,972,800	209,130,111,920
派生商品評価勘定	25,700,200	21,585,600
未収入金	1,607,086,927	54,771,424
未収配当金	1,163,416,707	1,318,386,836
流動資産合計	220,956,695,863	212,880,827,851
資産合計	220,956,695,863	212,880,827,851

負債の部		
流動負債		
前受金	33,300,000	19,080,000
未払金	189,094,400	-
未払解約金	23,048,500	33,638,000
その他未払費用	-	36,628
流動負債合計	245,442,900	52,754,628
負債合計	245,442,900	52,754,628
純資産の部		
元本等		
元本	1 93,103,935,587	84,332,707,170
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	127,607,317,376	128,495,366,053
元本等合計	220,711,252,963	212,828,073,223
純資産合計	220,711,252,963	212,828,073,223
負債純資産合計	220,956,695,863	212,880,827,851

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	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。
	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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	105,872,694,601円	93,103,935,587円
期中追加設定元本額	15,004,810,266円	2,626,807,773円
期中一部解約元本額	27,773,569,280円	11,398,036,190円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	9,847,773,031円	8,716,715,558円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	76,300,634,662円	68,142,761,531円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	394,808,043円	427,493,307円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,123円	29,232円
iFree J-REITイ ンデックス	124,681,806円	123,189,086円
iFree 8資産バランス	302,411,577円	399,539,969円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,533,542,169円	3,555,290,176円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,354,287円	3,004,643円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,785,265円	5,419,246円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,256,105円	1,334,004円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	55,539,603円	54,969,888円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	777,631,926円	930,375,961円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	1,417,548円	127,005,207円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	245,822,040円	351,439,370円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,509,250,402円	1,494,139,992円
計		93,103,935,587円	84,332,707,170円
2.	期末日における受益権の総数	93,103,935,587口	84,332,707,170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 332,400,000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 372,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18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								

不動産投信 指数先物取引								
買 建	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000	3,079,620,000	-	3,101,400,000	21,780,000
合計	3,028,450,000	-	3,054,350,000	25,900,000	3,079,620,000	-	3,101,400,000	21,780,000

(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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.3706円	2.5237円
(1万口当たり純資産額)	(23,706円)	(25,237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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	50,262,799	36,673,865
金銭信託	-	46,543,297
コール・ローン	91,529,565	101,322,057
投資信託受益証券	46,049,379	137,456,643
投資証券	13,832,110,951	16,506,382,110
派生商品評価勘定	471,338	727,581
未収入金	59,471	327,983
未収配当金	33,086,895	32,860,969

差入委託証拠金		13,517,642	37,401,429
流動資産合計		14,067,088,040	16,899,695,934
資産合計		14,067,088,040	16,899,695,934
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,995	1,225,447
未払金		50,712,789	51,267,381
未払解約金		1,061,000	8,637,000
その他未払費用		-	2,049
流動負債合計		51,782,784	61,131,877
負債合計		51,782,784	61,131,877
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,102,884,330	7,655,077,887
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,912,420,926	9,183,486,170
元本等合計		14,015,305,256	16,838,564,057
純資産合計		14,015,305,256	16,838,564,057
負債純資産合計		14,067,088,040	16,899,695,934

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</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)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>
<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、投資信託受益証券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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	2,861,359,942円	6,102,884,330円
期中追加設定元本額	3,616,858,632円	1,745,879,348円
期中一部解約元本額	375,334,244円	193,685,791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 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	3,150,065,335円	4,000,878,969円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	405,524,115円	539,964,683円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	204,326,703円	323,038,547円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	142,134,165円	227,542,963円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,191,277円	1,222,466円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	28,535円	35,023円
iFree 外国REITイ ンデックス	62,916,833円	70,426,843円
iFree 8資産バランス	313,141,173円	453,719,542円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,502,563,697円	1,584,037,239円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,481,750円	3,424,485円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,017,065円	6,256,261円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,160,118円	1,336,304円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	279,188,081円	284,336,411円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	22,068,351円	25,922,759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)	4,515,104円	128,533,234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)	4,562,028円	4,402,158円
計		6,102,884,330円	7,655,077,887円
2.	期末日における受益権の総数	6,102,884,330口	7,655,077,887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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	58,109,738	-	58,581,076	471,338	164,349,578	-	163,574,748	774,830
合計	58,109,738	-	58,581,076	471,338	164,349,578	-	163,574,748	774,830

(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。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18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	68,504,245	-	68,495,250	8,995	113,771,336	-	114,048,300	276,964
アメリカ・ドル	50,738,625	-	50,733,000	5,625	86,904,911	-	87,273,800	368,889
イギリス・ポンド	-	-	-	-	2,932,920	-	2,932,800	120
オーストラリア・ドル	7,323,812	-	7,323,600	212	2,055,015	-	2,055,000	15
シンガポール・ドル	10,441,808	-	10,438,650	3,158	9,022,600	-	8,983,700	38,900
ユーロ	-	-	-	-	12,855,890	-	12,803,000	52,890
合計	68,504,245	-	68,495,250	8,995	113,771,336	-	114,048,300	276,964

(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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2,2965円	2,1997円
(1万口当たり純資産額)	(22,965円)	(21,997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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	88,430,200
コール・ローン	163,546,995	192,507,416
国債証券	12,069,320,560	12,589,752,430
地方債証券	1,129,848,000	1,142,605,300
特殊債券	920,279,300	919,041,500
社債券	1,124,225,300	1,347,239,800
未収利息	49,739,724	49,176,088
前払費用	925,410	2,248,605
流動資産合計	15,457,885,289	16,331,001,339
資産合計	15,457,885,289	16,331,001,339
負債の部		

流動負債		
未払金	82,295,170	169,594,260
未払解約金	3,237,000	9,589,000
その他未払費用	-	1,209
流動負債合計	85,532,170	179,184,469
負債合計	85,532,170	179,184,469
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,102,682,064	12,655,250,834
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,269,671,055	3,496,566,036
元本等合計	15,372,353,119	16,151,816,870
純資産合計	15,372,353,119	16,151,816,870
負債純資産合計	15,457,885,289	16,331,001,339

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	11,776,318,682円	12,102,682,064円
期中追加設定元本額	2,838,779,099円	1,428,103,938円

期中一部解約元本額	2,512,415,717円	875,535,168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	50,696円	57,799円
iFree 日本債券インデックス	96,637,058円	103,797,372円
iFree 8資産バランス	565,941,197円	789,060,901円
ダイワ・ライフ・バランス30	5,146,920,747円	5,612,258,443円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,677,084,156円	2,946,999,651円
ダイワ・ライフ・バランス70	858,932,360円	959,066,637円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	614,116,560円	640,020,258円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	496,813,535円	526,145,380円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	154,223,264円	165,385,708円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	62,710,608円	59,345,262円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,788,441円	49,747,942円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,511,254円	4,614,008円
ダイワ世界バランスファンド40VA	759,134,105円	509,049,395円
ダイワ世界バランスファンド60VA	221,878,439円	213,509,760円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	195,536,040円	42,778,078円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	202,403,604円	33,414,240円
計	12,102,682,064円	12,655,250,834円
2. 期末日における受益権の総数	12,102,682,064口	12,655,250,834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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年12月18日現在	平成30年6月18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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	1,2702円	1,2763円
(1万口当たり純資産額)	(12,702円)	(12,763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29年12月18日現在	平成30年6月18日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	123,036,300	458,867,272
金銭信託	-	196,986,695
コール・ローン	793,027,061	428,828,613
国債証券	165,664,776,804	162,077,309,954
派生商品評価勘定	1,926,259	6,008,458
未収入金	-	1,582,574
未収利息	1,252,417,864	1,224,797,649
前払費用	26,076,341	33,014,803

流動資産合計		167,861,260,629	164,427,396,018
資産合計		167,861,260,629	164,427,396,018
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,432,087	937,302
未払解約金		54,270,025	52,989,717
その他未払費用		-	13,916
流動負債合計		55,702,112	53,940,935
負債合計		55,702,112	53,940,935
純資産の部			
元本等			
元本	1	59,323,594,737	60,455,977,437
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		108,481,963,780	103,917,477,646
元本等合計		167,805,558,517	164,373,455,083
純資産合計		167,805,558,517	164,373,455,083
負債純資産合計		167,861,260,629	164,427,396,018

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29年12月19日 至 平成30年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</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	為替予約取引

<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>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>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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1. 1 期首	平成28年12月20日	平成29年12月19日
期首元本額	58,881,648,354円	59,323,594,737円
期中追加設定元本額	6,379,737,514円	3,467,654,167円
期中一部解約元本額	5,937,791,131円	2,335,271,467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VA	937,476,924円	854,523,679円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	31,459,334円	29,450,309円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	232,118,354円	206,824,310円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	64,271,557円	57,761,758円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	758,526,259円	662,292,154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)	257,923,135円	353,138,235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)	551,455,042円	887,267,104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)	406,568,796円	641,273,428円
D-I's 外国債券インデッ クス	880,097円	935,352円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,820円	27,099円
iFree 外国債券イン デックス	592,031,307円	435,441,531円
iFree 8資産バランス	253,214,157円	369,690,770円
DCダイワ外国債券インデッ クス	39,940,525,208円	41,140,933,233円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	632,009,821円	719,164,381円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	300,452,088円	346,006,305円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	192,336,290円	225,103,257円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	273,754,216円	301,519,563円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	221,997,497円	247,547,179円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	68,923,747円	78,267,023円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,218,839円	11,128,249円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	17,808,259円	18,338,361円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,323,903円	1,700,379円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	480,519,859円	337,001,995円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	167,029,144円	168,856,742円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,370,904,816円	6,143,693,045円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	349,081,593円	80,686,083円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	135,747,380円	23,409,864円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	349,320,791円	349,404,648円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	127,522,458円	139,518,065円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	20,761,833円	26,769,670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)	374,472円	369,220円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,465,139,568円	5,480,616,302円
ダイワライフスタイル25	34,460,276円	35,961,351円
ダイワライフスタイル50	59,917,401円	63,382,926円
ダイワライフスタイル75	16,517,496円	17,973,867円
計	59,323,594,737円	60,455,977,437円
2. 期末日における受益権の総数	59,323,594,737口	60,455,977,437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30年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年12月18日 現在				平成30年6月18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	785,504,328	-	785,998,500	494,172	566,122,004	-	571,193,160	5,071,156
アメリカ・ドル	315,000,980	-	316,293,600	1,292,620	256,557,192	-	260,638,400	4,081,208
イギリス・ポンド	87,408,770	-	87,156,600	252,170	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	11,529,794	-	11,697,360	167,566	16,985,074	-	16,996,770	11,696
カナダ・ドル	16,170,933	-	16,278,720	107,787	10,541,009	-	10,544,940	3,931
シンガポール・ドル	8,296,250	-	8,343,000	46,750	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	8,895,027	-	8,869,380	25,647	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	15,871,398	-	15,662,080	209,318
ユーロ	338,202,574	-	337,359,840	842,734	246,044,325	-	247,738,050	1,693,725
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	20,123,006	-	19,612,920	510,086
合計	785,504,328	-	785,998,500	494,172	566,122,004	-	571,193,160	5,071,156

(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12月18日現在	平成30年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.8286円	2.7189円
(1万口当たり純資産額)	(28,286円)	(27,189円)

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2018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。

(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。

2018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	81	182,094
追加型株式投資信託	702	15,543,648
株式投資信託 合計	783	15,725,742
単位型公社債投資信託	26	101,114
追加型公社債投資信託	14	1,494,713
公社債投資信託 合計	40	1,595,828
総合計	823	17,321,570

(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29年4月1日から平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316

役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27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30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26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代行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29年3月31日)

(単位:百万円)

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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30年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-

(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	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	1,050	1,072

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

当事業年度(平成30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	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
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	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(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、記載していません。

当事業年度(平成30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、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度(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」には含めていません。

当事業年度(平成30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	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
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	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、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いません。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

(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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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29年3月31日）

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。

当事業年度（平成30年3月31日）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 平成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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

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28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
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30年 5月25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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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30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30年7月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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29年12月19日から平成30年6月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の平成30年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成29年12月19日から平成30年6月18日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。