

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年9月11日提出
【計算期間】	第12計算期間中 (自 2018年12月19日 至 2019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 松下 浩一
【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】	西脇 保宏
【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】 (2019年6月28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	50,899,827	99.80
内 日本	50,899,827	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	101,449	0.20
純資産総額	51,001,276	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
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802
2018年6月末日	41,692,328	-	1.5534	-
7月末日	43,087,646	-	1.5760	-
8月末日	45,161,741	-	1.5787	-
9月末日	49,080,001	-	1.6238	-

10月末日	47,892,398	-	1.5266	-
11月末日	46,849,674	-	1.5519	-
第11計算期間末 (2018年12月18日)	45,018,917	45,018,917	1.4875	1.4875
12月末日	43,712,206	-	1.4437	-
2019年1月末日	47,692,608	-	1.5048	-
2月末日	48,873,318	-	1.5449	-
3月末日	50,118,196	-	1.5591	-
4月末日	51,708,618	-	1.5802	-
5月末日	47,999,027	-	1.5195	-
6月末日	51,001,276	-	1.5515	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第11計算期間	0.0000
2018年12月19日 ~ 2019年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第11計算期間	5.9

2018年12月19日～ 2019年6月18日	3.6
----------------------------	-----

(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 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	136,528,797,240	99.28
内 日本	136,528,797,240	99.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	987,472,928	0.72
純資産総額	137,516,270,168	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)	1,209,780,000	0.88
内 日本	1,209,780,000	0.88

(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 (2019年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	109,266,313,042	95.77
内 香港	1,579,453,356	1.38
内 シンガポール	511,814,600	0.45
内 イスラエル	237,701,195	0.21
内 ノルウェー	280,092,477	0.25
内 スウェーデン	1,111,219,030	0.97
内 デンマーク	711,862,636	0.62
内 イギリス	6,938,164,230	6.08

内 アイルランド	225,946,989	0.20
内 オランダ	1,500,357,666	1.32
内 ベルギー	403,332,292	0.35
内 フランス	4,632,445,395	4.06
内 ドイツ	3,665,830,557	3.21
内 スイス	3,891,618,788	3.41
内 ポルトガル	60,383,865	0.05
内 スペイン	1,237,195,312	1.08
内 イタリア	963,929,770	0.84
内 フィンランド	415,090,436	0.36
内 オーストリア	88,818,601	0.08
内 カナダ	4,251,221,969	3.73
内 アメリカ	73,814,148,024	64.70
内 オーストラリア	2,644,199,230	2.32
内 ニューゼaland	101,486,624	0.09
投資証券	3,152,156,649	2.76
内 香港	106,155,972	0.09
内 シンガポール	53,465,838	0.05
内 イギリス	70,300,836	0.06
内 フランス	122,014,003	0.11
内 カナダ	21,101,920	0.02
内 アメリカ	2,414,717,886	2.12
内 オーストラリア	364,400,194	0.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,668,371,795	1.46
純資産総額	114,086,841,486	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)	1,816,611,818	1.59
内 アメリカ	1,816,611,818	1.59
為替予約取引(買建)	527,779,000	0.46
内 日本	527,779,000	0.46

(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 (2019年6月28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	283,269,546,670	98.60
内 日本	283,269,546,670	98.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,009,132,355	1.40
純資産総額	287,278,679,025	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)	3,842,000,000	1.34
内 日本	3,842,000,000	1.34

(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 (2019年6月28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	204,669,496	0.92
内 アメリカ	204,669,496	0.92
投資証券	21,785,381,758	97.77
内 ガーンジー	38,166,511	0.17
内 マン島	5,951,752	0.03
内 韓国	3,761,856	0.02
内 香港	553,592,931	2.48
内 シンガポール	875,001,480	3.93
内 イスラエル	15,912,326	0.07
内 イギリス	1,038,961,604	4.66
内 アイルランド	56,758,749	0.25

内 オランダ	56,592,959	0.25
内 ベルギー	201,457,000	0.90
内 フランス	843,385,297	3.78
内 ドイツ	59,002,967	0.26
内 スペイン	151,297,274	0.68
内 イタリア	4,448,445	0.02
内 カナダ	425,269,842	1.91
内 アメリカ	15,742,835,519	70.65
内 オーストラリア	1,605,647,268	7.21
内 ニュージーランド	107,337,978	0.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	292,556,096	1.31
純資産総額	22,282,607,350	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)	272,512,535	1.22
内 ドイツ	49,516,583	0.22
内 アメリカ	222,995,952	1.00
為替予約取引(買建)	138,568,450	0.62
内 日本	138,568,450	0.62

(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 (2019年6月28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	15,271,636,270	83.25
内 日本	15,271,636,270	83.25
地方債証券	1,141,520,400	6.22
内 日本	1,141,520,400	6.22
特殊債券	716,361,000	3.90
内 日本	716,361,000	3.90
社債券	1,044,095,200	5.69
内 日本	1,044,095,200	5.69

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	171,243,245	0.93
純資産総額	18,344,856,115	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 (2019年6月28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	173,863,649,431	98.33
内 ユーロ	67,306,863,651	38.07
内 シンガポール	691,971,343	0.39
内 マレーシア	812,827,646	0.46
内 ノルウェー	422,431,250	0.24
内 スウェーデン	619,169,833	0.35
内 デンマーク	887,294,456	0.50
内 イギリス	11,083,093,002	6.27
内 ポーランド	1,042,043,221	0.59
内 カナダ	3,370,347,903	1.91
内 アメリカ	81,713,704,513	46.22
内 メキシコ	1,420,336,583	0.80
内 南アフリカ	986,127,716	0.56
内 オーストラリア	3,507,438,314	1.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,944,189,285	1.67
純資産総額	176,807,838,716	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)	1,657,486,540	0.94
内 日本	1,657,486,540	0.94

(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

2019年6月28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	15,515円
純資産総額	51百万円



※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	第11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	18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	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	2,127	36.9%	日本円	60.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.2%	
外国株式・先物	1,264	20.5%	米ドル	25.1%	最終利回り(%)	ソフトバンクグループ	日本	0.7%	
国内債券	266	14.8%	ユーロ	7.5%	修正デュレーション	ソニー	日本	0.6%	
外国債券	772	11.8%	英ポンド	2.4%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%	
国内リート・先物	64	8.0%	豪ドル	1.3%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.6%	
外国リート・先物	311	7.3%	カナダドル	1.2%	AAA	84.7%	日本ビルファンド	日本	0.6%
外国投資信託等	9	0.1%	スイスフラン	0.7%	AA	6.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
			香港ドル	0.5%	A	6.0%	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	0.3%	日本リート	日本	0.3%
コール・ローン、その他		1.3%	その他	0.9%	BB以下・無格付	2.2%	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.3%
合計	4,813	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	5.9%	

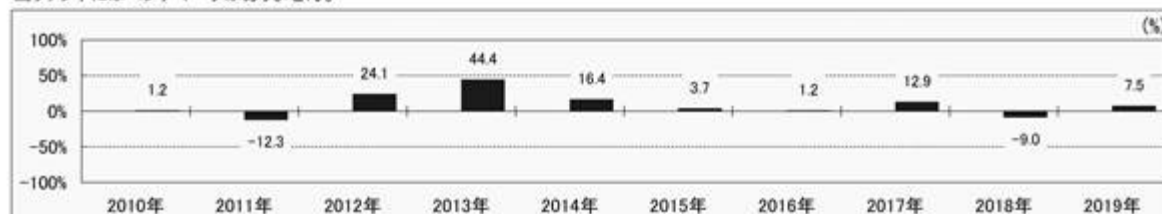
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.2%保有しております。

※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。

・2019年は6月28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
第11計算期間	9,247,574	2,870,316
2018年12月19日 ~ 2019年6月18日	6,268,149	3,741,151

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(2018年12月19日から2019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 2018年12月18日現在	当中間計算期間末 2019年6月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	34,957	-
コール・ローン	146,425	194,792
親投資信託受益証券	44,928,054	50,432,716
流動資産合計	45,109,436	50,627,508
資産合計	45,109,436	50,627,508
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	7,359	7,784
未払委託者報酬	81,409	86,322
その他未払費用	1,751	1,878
流動負債合計	90,519	95,984
負債合計	90,519	95,984
純資産の部		
元本等		
元本	1 30,264,603	1 32,791,601
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	14,754,314	17,739,923
(分配準備積立金)	7,344,925	6,540,314
元本等合計	45,018,917	50,531,524
純資産合計	45,018,917	50,531,524
負債純資産合計	45,109,436	50,627,508

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2017年12月19日 至 2018年6月18日	当中間計算期間 自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	53,751	1,828,662
営業収益合計	53,751	1,828,662
営業費用		
受託者報酬	6,425	7,784
委託者報酬	71,060	86,322
その他費用	1,518	1,878
営業費用合計	79,003	95,984
営業利益又は営業損失()	132,754	1,732,678
経常利益又は経常損失()	132,754	1,732,678
中間純利益又は中間純損失()	132,754	1,732,678
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	2,655	209,279
期首剰余金又は期首欠損金()	13,859,538	14,754,314
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,032,962	3,298,618
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,032,962	3,298,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	442,130	1,836,408
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	442,130	1,836,408
中間剰余金又は中間欠損金()	15,314,961	17,739,923

(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 2018年12月19日	至 2019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
	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首元本額	23,887,345円	30,264,603円
期中追加設定元本額	9,247,574円	6,268,149円
期中一部解約元本額	2,870,316円	3,741,151円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	30,264,603口	32,791,601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 2017年12月19日 至 2018年6月18日	自 2018年12月19日 至 2019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 2019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 2018年12月18日現在	当中間計算期間末 2019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 2018年12月18日現在	当中間計算期間末 2019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)	1.4875円 (14,875円)	1.5410円 (15,410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

	2018年12月18日現在	2019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	3,981,864,844	-
コール・ローン	16,678,698,103	20,518,019,920

株式	3 4	132,803,813,650	133,196,924,740
未収入金		2,682,956	24,540,100
未収配当金		16,140,750	1,081,966,113
未収利息		719,210	780,557
前払金		11,280,000	-
その他未収収益	5	4,527,606	37,525,116
流動資産合計		153,499,727,119	154,859,756,546
資産合計		153,499,727,119	154,859,756,546
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		28,126,860	11,036,280
前受金		-	2,135,000
未払解約金		58,304,300	56,423,500
受入担保金		19,684,511,815	19,577,434,830
その他未払費用		81,047	-
流動負債合計		19,771,024,022	19,647,029,610
負債合計		19,771,024,022	19,647,029,610
純資産の部			
元本等			
元本	1	134,974,559,390	137,609,256,631
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	2	1,245,856,293	2,396,529,695
元本等合計		133,728,703,097	135,212,726,936
純資産合計		133,728,703,097	135,212,726,936
負債純資産合計		153,499,727,119	154,859,756,546

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18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	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	128,399,557,544円	134,974,559,390円
期中追加設定元本額	18,708,118,755円	9,965,797,638円
期中一部解約元本額	12,133,116,909円	7,331,100,397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	4,201,513,179円	4,064,718,502円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	8,723,420,410円	7,809,558,561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	50,876,443円	28,922,843円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	65,059,832円	60,746,661円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,048,156,296円	970,087,745円

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	59,087,088円	49,591,649円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,439,870,693円	1,345,886,376円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	4,688,328円	18,427,623円
D-I's TOPIXイン デックス	40,048,507円	40,206,774円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	20,229,721円	20,284,281円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	687,039円	1,813,332円
iFree TOPIXイン デックス	806,893,142円	1,098,419,689円
iFree 8資産バランス	1,341,607,768円	1,722,463,213円
iFree 年金バランス	19,858,640円	45,552,958円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,589,578,535円	65,604,106,366円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,638,256,874円	2,830,723,893円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,934,310,951円	3,175,206,497円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,837,773,343円	2,924,490,418円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,616,032,022円	4,894,631,904円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,233,589円	15,661,912円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	53,028,188円	51,777,925円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	16,953,280円	18,725,917円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	18,427,073円	125,977,111円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	198,705円
ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	298,057円

ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	447,086円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	350,718円	370,487円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	359,201円	380,895円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	712,052円	748,462円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,149,572円	4,378,927円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,912,940円	4,332,378円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	9,756,807円	8,522,639円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	184,088,109円	171,234,737円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	161,522,359円	171,314,178円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,663,609,360円	9,583,310,698円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	11,266,082円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	14,433,489円	2,950,347円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	825,057,420円	830,881,612円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	129,734,372円	127,351,633円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	221,128,598円	223,926,223円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	145,177,137円	164,335,677円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	8,514,418,449円	8,975,916,690円
ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	305,043,025円	1,902,082,431円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	1,909,937,672円	2,518,241,712円

	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,392,102,290円	1,424,824,797円
	ダイワライフスタイル25	181,541,595円	192,967,338円
	ダイワライフスタイル50	651,110,098円	678,951,850円
	ダイワライフスタイル75	544,233,554円	559,987,603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)	13,558,323,550円	13,143,319,319円
	計	134,974,559,390円	137,609,256,631円
2.	期末日における受益権の総数	134,974,559,390口	137,609,256,631口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,245,856,293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2,396,529,695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 18,392,303,350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 18,392,021,000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 677,500,000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 481,500,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分2,970,375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35,890,363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	2019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	2018年12月18日 現在				2019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	948,200,000	-	920,105,000	28,095,000	2,023,965,000	-	2,013,000,000	10,965,000
合計	948,200,000	-	920,105,000	28,095,000	2,023,965,000	-	2,013,000,000	10,965,000

(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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	0.9908円	0.9826円
(1万口当たり純資産額)	(9,908円)	(9,826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

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	328,173,314	530,947,365
金銭信託	63,196,362	-
コール・ローン	264,708,392	310,012,779
株式	96,598,974,693	107,809,021,772
投資証券	2,730,416,158	3,235,341,313
派生商品評価勘定	-	861,495
未収入金	461,333	3,673,530
未収配当金	136,354,519	176,539,075
差入委託証拠金	744,120,976	536,458,376
流動資産合計	100,866,405,747	112,602,855,705
資産合計	100,866,405,747	112,602,855,705
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,605,952	-
未払金	-	11,606,889
未払解約金	3,167,800	20,495,900
その他未払費用	3,729	764,215
流動負債合計	32,777,481	32,867,004
負債合計	32,777,481	32,867,004
純資産の部		
元本等		
元本	1 44,096,261,199	44,946,577,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	56,737,367,067	67,623,411,109
元本等合計	100,833,628,266	112,569,988,701
純資産合計	100,833,628,266	112,569,988,701
負債純資産合計	100,866,405,747	112,602,855,705

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>原則として、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>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	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	39,738,227,827円	44,096,261,199円
期中追加設定元本額	7,465,582,702円	3,105,384,525円
期中一部解約元本額	3,107,549,330円	2,255,068,132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	499,385,747円	460,586,000円
V A		
ダイワ国内重視バランスファ	14,096,372円	12,197,180円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	195,204,265円	165,854,025円
ンド50VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国際分散バランスファ	25,078,769円	19,605,630円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国際分散バランスファ	623,000,121円	534,030,281円
ンド50VA(一般投資家私		
募)		

外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	846,375円	3,249,110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)	553,148,518円	554,018,213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)	1,514,122,256円	1,807,001,571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)	532,534,499円	537,665,428円
D-I's 外国株式インデックス	5,540,781円	6,557,780円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	197,868円	493,277円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	737,760,888円	907,222,731円
iFree 8資産バランス	579,355,553円	683,828,509円
iFree 年金バランス	8,552,977円	18,051,051円
DCダイワ外国株式インデックス	27,685,196,810円	28,414,228,575円
ダイワ・ライフ・バランス30	571,047,005円	566,725,995円
ダイワ・ライフ・バランス50	844,962,807円	846,970,888円
ダイワ・ライフ・バランス70	681,438,616円	648,485,560円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,490,108,018円	1,489,890,251円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	4,180,386円	3,399,663円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	13,352,537円	13,174,854円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,236,847円	4,250,389円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	6,232,510円	64,244,189円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	39,782円

ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	79,563円
ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	99,454円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	76,173円	73,565円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	156,042円	151,649円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	1,204,032円	1,162,691円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	2,140,945円	1,725,194円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	238,397,161円	205,401,310円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	348,671,890円	345,545,113円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,140,769,877円	2,865,699,348円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	153,782,925円	147,509,273円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	635,373,798円	664,013,511円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	88,789,723円	108,061,389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)	453,618円	6,602,114円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,748,317,297円	2,695,756,099円
ダイワライフスタイル25	19,476,612円	19,225,455円
ダイワライフスタイル50	70,259,055円	67,892,598円
ダイワライフスタイル75	58,811,526円	55,808,334円
計	44,096,261,199円	44,946,577,592円
2. 期末日における受益権の総数	44,096,261,199口	44,946,577,592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	2019年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2018年12月18日 現在				2019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	1,454,705,923	-	1,426,902,061	27,803,862	1,587,325,591	-	1,588,097,866	772,275
合計	1,454,705,923	-	1,426,902,061	27,803,862	1,587,325,591	-	1,588,097,866	772,275

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2018年12月18日 現在				2019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			(円)	うち		

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090	357,696,780	-	357,786,000	89,220
アメリカ・ドル	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090	357,696,780	-	357,786,000	89,220
合計	271,802,090	-	270,000,000	1,802,090	357,696,780	-	357,786,000	89,220

(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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.2867円	2.5045円
(1万口当たり純資産額)	(22,867円)	(25,045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。

	2018年12月18日現在	2019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	586,413,834	-
コール・ローン	2,456,291,131	4,691,865,150
投資証券 2	218,552,442,750	275,565,460,950
派生商品評価勘定	13,305,600	29,184,000
未収配当金	1,086,606,834	1,409,944,053
流動資産合計	222,695,060,149	281,696,454,153
資産合計	222,695,060,149	281,696,454,153
負債の部		
流動負債		
前受金	39,600,000	27,400,000
未払金	-	1,260,716,666
未払解約金	28,367,900	50,222,400
その他未払費用	12,811	-
流動負債合計	67,980,711	1,338,339,066
負債合計	67,980,711	1,338,339,066
純資産の部		
元本等		
元本 1	83,618,179,092	95,956,371,908
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	139,008,900,346	184,401,743,179
元本等合計	222,627,079,438	280,358,115,087
純資産合計	222,627,079,438	280,358,115,087
負債純資産合計	222,695,060,149	281,696,454,153

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<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、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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	93,103,935,587円	83,618,179,092円
期中追加設定元本額	7,997,501,780円	14,411,838,425円
期中一部解約元本額	17,483,258,275円	2,073,645,609円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	7,302,744,511円	6,814,159,423円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	68,216,833,743円	80,466,287,689円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	373,979,635円	339,767,050円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	28,858円	79,957円
iFree J-REITイ ンデックス	126,035,282円	96,949,729円
iFree 8資産バランス	515,506,552円	590,869,858円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,890,262,175円	4,404,226,207円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,733,692円	2,455,461円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,348,275円	4,838,857円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,385,927円	1,399,634円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	46,340,607円	50,411,216円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	1,007,319,809円	1,118,256,297円
	ダイワ J - REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	389,109,116円	426,314,579円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	382,869,897円	374,359,443円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,357,681,013円	1,265,996,508円
計		83,618,179,092円	95,956,371,908円
2.	期末日における受益権の総数	83,618,179,092口	95,956,371,908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 414,600,000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 453,600,000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	2019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	2018年12月18日 現在				2019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	3,189,600,000	-	3,203,100,000	13,500,000	3,803,600,000	-	3,833,000,000	29,400,000
合計	3,189,600,000	-	3,203,100,000	13,500,000	3,803,600,000	-	3,833,000,000	29,400,000

(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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.6624円	2.9217円
(1万口当たり純資産額)	(26,624円)	(29,217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

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	113,722,457	60,577,909
金銭信託	18,580,949	-
コール・ローン	77,829,373	154,182,740
投資信託受益証券	168,584,393	140,767,238
投資証券	18,608,705,787	22,435,369,195
派生商品評価勘定	26,626	2,431,570
未収入金	8,046	527,305
未収配当金	38,184,704	38,672,619
差入委託証拠金	51,308,493	59,738,202
流動資産合計	19,076,950,828	22,892,266,778
資産合計	19,076,950,828	22,892,266,778
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,625,585	113,223
未払金	63,681,085	69,023,980
未払解約金	4,748,300	13,660,000
その他未払費用	522	-
流動負債合計	75,055,492	82,797,203
負債合計	75,055,492	82,797,203
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,605,559,107	9,336,470,536
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,396,336,229	13,472,999,039
元本等合計	19,001,895,336	22,809,469,575
純資産合計	19,001,895,336	22,809,469,575
負債純資産合計	19,076,950,828	22,892,266,778

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
----	-------------------------------

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<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>

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	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	6,102,884,330円	8,605,559,107円
期中追加設定元本額	3,189,233,518円	1,284,529,005円
期中一部解約元本額	686,558,741円	553,617,576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)	4,250,708,821円	4,507,886,136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)	607,517,253円	686,971,736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)	332,616,245円	334,540,901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)	243,780,173円	229,567,663円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,218,823円	1,216,249円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	33,252円	79,996円
iFree 外国REITイ ンデックス	76,699,942円	83,936,413円
iFree 8資産バランス	595,418,401円	710,450,097円

DCダイワ・グローバルREIT	1,752,831,763円	1,995,608,217円
ITインデックスファンド		
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,180,473円	2,943,144円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,164,552円	5,830,872円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,416,414円	1,473,077円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	258,789,793円	247,516,568円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	26,738,838円	29,835,439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)	227,933,210円	285,004,866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)	220,511,154円	213,609,162円
計	8,605,559,107円	9,336,470,536円
2. 期末日における受益権の総数	8,605,559,107口	9,336,470,536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	2019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	2018年12月18日 現在				2019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	130,736,956	-	124,243,076	6,493,880	217,020,290	-	219,033,679	2,013,389
合計	130,736,956	-	124,243,076	6,493,880	217,020,290	-	219,033,679	2,013,389

(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	2018年12月18日 現在				2019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								
売 建	32,401,000	-	32,400,000	1,000	-	-	-	-
オーストラリア ・ドル	32,401,000	-	32,400,000	1,000	-	-	-	-
買 建	95,441,079	-	95,335,000	106,079	112,316,642	-	112,621,600	304,958
アメリカ・ドル	73,289,079	-	73,179,000	110,079	87,471,085	-	87,851,700	380,615

イギリス・ポンド	-	-	-	-	8,257,836	-	8,164,800	93,036
オーストラリア・ドル	8,080,600	-	8,082,000	1,400	-	-	-	-
カナダ・ドル	5,871,600	-	5,873,000	1,400	7,247,561	-	7,280,100	32,539
シンガポール・ドル	8,199,800	-	8,201,000	1,200	7,920,800	-	7,915,000	5,800
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	1,419,360	-	1,410,000	9,360
合計	127,842,079	-	127,735,000	105,079	112,316,642	-	112,621,600	304,958

(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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.2081円	2.4431円
(1万口当たり純資産額)	(22,081円)	(24,431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

	2018年12月18日現在	2019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	16,117,091	-
コール・ローン	67,509,097	125,588,588
国債証券	14,078,326,560	15,204,412,260
地方債証券	1,039,704,300	1,143,668,500
特殊債券	919,529,500	716,437,900
社債券	1,045,422,100	1,044,542,200
未収利息	51,890,376	50,333,045
前払費用	1,086,624	1,395,128
流動資産合計	17,219,585,648	18,286,377,621
資産合計	17,219,585,648	18,286,377,621
負債の部		
流動負債		
未払金	-	56,853,300
未払解約金	356,000	3,124,036
その他未払費用	519	-
流動負債合計	356,519	59,977,336
負債合計	356,519	59,977,336
純資産の部		
元本等		
元本	1 13,470,544,219	13,927,914,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,748,684,910	4,298,485,784
元本等合計	17,219,229,129	18,226,400,285
純資産合計	17,219,229,129	18,226,400,285
負債純資産合計	17,219,585,648	18,286,377,621

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2018年12月19日 至 2019年6月18日
----	-------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	12,102,682,064円	13,470,544,219円
期中追加設定元本額	2,604,701,757円	1,264,642,846円
期中一部解約元本額	1,236,839,602円	807,272,564円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン	12,700,496円	43,512,468円
ド(FOFs用)(適格機関投資		
家専用)		
DCダイワ・ターゲットイ	59,366円	147,207円
ヤー2050		
iFree 日本債券イン	115,879,263円	128,280,974円
デックス		
iFree 8資産バランス	1,073,449,867円	1,313,349,704円
ダイワ・ライフ・バランス3	5,864,740,765円	5,940,595,403円
0		
ダイワ・ライフ・バランス5	3,186,852,570円	3,227,857,027円
0		
ダイワ・ライフ・バランス7	1,030,403,541円	991,881,217円
0		
DCダイワ・ワールドアセッ	712,638,846円	778,776,381円
ト(六つの羽/安定コース)		
DCダイワ・ワールドアセッ	571,642,583円	612,247,192円
ト(六つの羽/6分散コー		
ス)		

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	179,007,932円	199,852,802円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	56,559,291円	54,575,749円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	51,345,213円	53,937,496円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,092,545円	5,820,519円
ダイワつみたてインデックス日本債券	5,135,055円	63,117,645円
ダイワつみたてインデックスバランス30	-円	419,453円
ダイワつみたてインデックスバランス50	-円	305,057円
ダイワつみたてインデックスバランス70	-円	152,529円
ダイワ世界バランスファンド40VA	382,555,859円	320,567,682円
ダイワ世界バランスファンド60VA	201,393,773円	190,225,395円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	9,240,428円	-円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	11,846,826円	2,292,601円
計	13,470,544,219円	13,927,914,501円
2. 期末日における受益権の総数	13,470,544,219口	13,927,914,501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	2019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

2018年12月18日現在	2019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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.2783円	1.3086円
(1万口当たり純資産額)	(12,783円)	(13,086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

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	147,401,950	301,610,418
金銭信託	164,535,577	-
コール・ローン	689,184,423	1,020,627,338
国債証券	167,455,873,047	172,577,005,055
派生商品評価勘定	26,908	714,238
未収入金	12,417	210,828
未収利息	1,232,206,917	1,191,581,928
前払費用	35,796,651	35,712,024
流動資産合計	169,725,037,890	175,127,461,829
資産合計	169,725,037,890	175,127,461,829
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,343,318	3,116,459
未払金	175,727	1,168,600
未払解約金	33,250,979	31,953,251
その他未払費用	5,620	-
流動負債合計	39,775,644	36,238,310
負債合計	39,775,644	36,238,310
純資産の部		

元本等			
元本	1	61,406,010,061	62,754,354,808
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		108,279,252,185	112,336,868,711
元本等合計		169,685,262,246	175,091,223,519
純資産合計		169,685,262,246	175,091,223,519
負債純資産合計		169,725,037,890	175,127,461,829

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月19日 至 2019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	<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	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1. 1 期首	2017年12月19日	2018年12月19日
期首元本額	59,323,594,737円	61,406,010,061円
期中追加設定元本額	6,439,352,239円	3,130,082,272円
期中一部解約元本額	4,356,936,915円	1,781,737,525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	690,377,947円	652,620,225円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,063,629円	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	171,491,829円	147,272,269円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	52,710,212円	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	542,916,644円	478,956,132円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	2,206,505円	12,135,645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)	358,202,378円	383,469,892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)	1,129,646,948円	1,318,407,779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)	707,663,901円	773,960,847円
D-I's 外国債券インデッ クス	731,384円	2,268,798円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,109円	69,170円
iFree 外国債券イン デックス	503,496,973円	559,596,492円
iFree 8資産バランス	492,941,040円	613,844,744円
iFree 年金バランス	4,389,691円	9,717,259円
DCダイワ外国債券インデッ クス	42,429,483,894円	43,741,677,210円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	739,788,743円	758,422,044円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	368,136,096円	377,628,316円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	237,768,692円	231,907,260円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	329,260,143円	364,164,600円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	263,486,369円	286,366,993円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	82,547,093円	93,532,652円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	10,485,123円	10,210,959円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	18,657,551円	18,516,474円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,851,074円	2,180,071円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	1,402,439円	31,345,881円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	53,558円
ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	35,706円

ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	35,706円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	246,851,720円	211,467,656円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	154,707,266円	149,389,183円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,641,456,746円	5,222,112,367円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	17,076,090円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	8,179,618円	1,603,962円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	325,032,492円	308,506,848円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	142,904,084円	148,248,943円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	28,395,905円	30,713,189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)	27,703,290円	3,934,856円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,533,310,797円	5,634,026,324円
ダイワライフスタイル25	35,190,841円	34,452,178円
ダイワライフスタイル50	62,125,559円	60,559,548円
ダイワライフスタイル75	17,342,246円	16,763,992円
計	61,406,010,061円	62,754,354,808円
2. 期末日における受益権の総数	61,406,010,061口	62,754,354,808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	2019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	2018年12月18日 現在				2019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	786,889,450	-	780,573,040	6,316,410	984,911,981	-	982,509,760	2,402,221
アメリカ・ドル	228,409,947	-	227,443,340	966,607	451,698,265	-	450,242,880	1,455,385
イギリス・ポンド	42,976,998	-	42,212,610	764,388	65,906,553	-	65,459,290	447,263
オーストラリア・ドル	14,552,556	-	14,227,840	324,716	3,850,994	-	3,793,890	57,104
カナダ・ドル	48,774,121	-	48,421,840	352,281	51,595,479	-	51,695,100	99,621
シンガポール・ドル	12,623,052	-	12,550,590	72,462	23,732,703	-	23,748,000	15,297
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	2,156,276	-	2,152,600	3,676
デンマーク・クローネ	28,784,040	-	28,487,190	296,850	7,784,257	-	7,784,640	383
ノルウェー・クローネ	7,193,659	-	7,108,920	84,739	12,093,167	-	12,081,960	11,207
ポーランド・ズロチ	10,785,429	-	10,701,790	83,639	23,728,799	-	23,904,720	175,921
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	20,124,048	-	20,366,040	241,992
ユーロ	392,789,648	-	389,418,920	3,370,728	314,162,787	-	313,250,640	912,147
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	8,078,653	-	8,030,000	48,653

合計	786,889,450	-	780,573,040	6,316,410	984,911,981	-	982,509,760	2,402,221
----	-------------	---	-------------	-----------	-------------	---	-------------	-----------

(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)

	2018年12月18日現在	2019年6月18日現在
1口当たり純資産額	2.7633円	2.7901円
(1万口当たり純資産額)	(27,633円)	(27,901円)

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2019年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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。

2019年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	75	145,253
追加型株式投資信託	721	15,318,969
株式投資信託 合計	796	15,464,222
単位型公社債投資信託	30	111,005
追加型公社債投資信託	14	1,392,102
公社債投資信託 合計	44	1,503,108
総合計	840	16,967,330

(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(2018年4月1日から2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
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	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益	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	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
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	13,850	14,225	40,895

	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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
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	41,112

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計		
		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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

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。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の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、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度(2018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。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日至2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018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	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は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。

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(2018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。

当事業年度(2019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		28,489	28,489	-

(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(*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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018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

当事業年度(2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)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(2018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。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2)その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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 2017年4月1日 至 2018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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2)その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

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おります。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引(譲渡益)は480百万円減少しております。

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(2018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(2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
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)	23,216	未払手数料	3,913
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)	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(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)	1,048	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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)(注1)
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)	19,975	未払手数料	3,400
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)	1,052	未払費用	173
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)	1,063	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せん。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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おりません。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870

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

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び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

2019年7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 公認会計士 深井 康治 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2018年12月19日から2019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2019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(2018年12月19日から2019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。