

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書の訂正届出書

**【提出先】** 関東財務局長 殿

**【提出日】** 平成29年2月2日提出

**【発行者名】** 大和証券投資信託委託株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 岩本 信之

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【事務連絡者氏名】** 山村 政  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【電話番号】** 03-5555-3111

**【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券に係る  
ファンドの名称】** スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）

**【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券の金  
額】** 継続申込期間（平成28年8月3日から平成29年8月1日ま  
で）  
10兆円を上限とします。

**【縦覧に供する場所】** 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年8月2日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

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

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（平成28年11月末日現在）>

<略>

#### 2 【投資方針】

##### (3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

上記の運用体制は平成28年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### 3 【投資リスク】

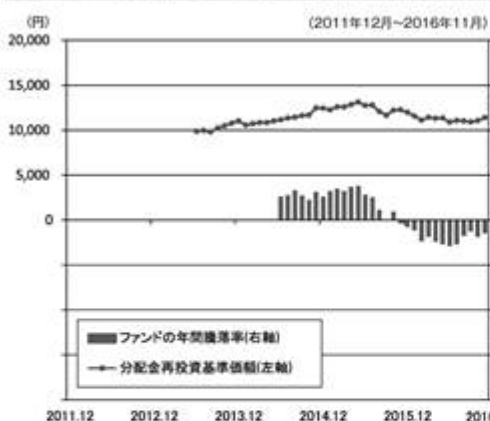
<更新後>

<略>

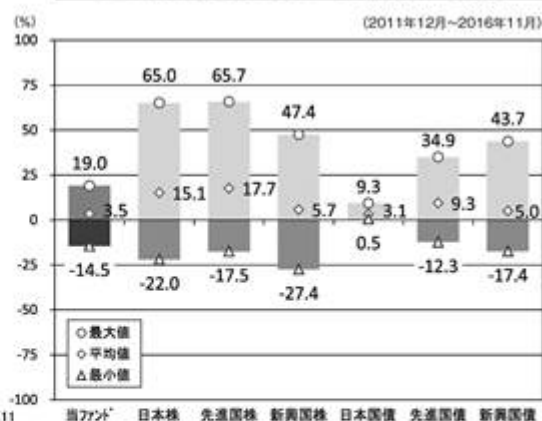
## 参考情報

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

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

( ) 上記は、平成28年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

## 5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

## (1) 【投資状況】（平成28年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	66,546,631	99.12
内 日本	66,546,631	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	592,664	0.88
純資産総額	67,139,295	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年11月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	先進国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,874,119	1.1162 11,022,440	1.1282 11,139,981	16.59
2	国内株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,006,161	1.2545 10,043,809	1.3884 11,115,753	16.56
3	先進国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,746,110	1.3234 10,251,253	1.4309 11,083,908	16.51
4	国内債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,974,321	1.1243 11,214,378	1.1103 11,074,488	16.49
5	新興国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,318,720	1.0035 10,355,837	1.0729 11,070,954	16.49
6	新興国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,799,258	1.2226 10,758,375	1.2571 11,061,547	16.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成26年5月8日)	23,326,761	23,326,761	1.0861	1.0861
第2計算期間末 (平成27年5月8日)	48,841,040	48,841,040	1.2768	1.2768
平成27年11月末日	57,417,275	-	1.2264	-
12月末日	56,715,272	-	1.1979	-
平成28年1月末日	57,084,484	-	1.1567	-
2月末日	56,220,577	-	1.1119	-
3月末日	61,984,952	-	1.1412	-
4月末日	64,176,413	-	1.1303	-
第3計算期間末 (平成28年5月9日)	62,760,021	62,760,021	1.1075	1.1075
5月末日	63,855,708	-	1.1348	-
6月末日	61,616,282	-	1.0896	-
7月末日	63,005,338	-	1.1076	-
8月末日	63,028,974	-	1.1024	-
9月末日	62,397,146	-	1.0921	-
10月末日	64,132,979	-	1.1066	-
11月末日	67,139,295	-	1.1379	-

## 【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
平成28年5月10日～ 平成28年11月9日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.6
第2計算期間	17.6
第3計算期間	13.3
平成28年5月10日～ 平成28年11月9日	2.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	56,888,148	38,410,699
第2計算期間	28,897,714	12,122,699
第3計算期間	24,110,129	5,695,207
平成28年5月10日～ 平成28年11月9日	2,405,980	1,072,295

(注) 当初設定数量は3,000,000口です。

(参考) マザーファンド  
国内株式マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	760,031,742	22.33
内 日本	760,031,742	22.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,644,227,811	77.67
純資産総額	3,404,259,553	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)	3,403,466,000	99.98
内 日本	3,403,466,000	99.98

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	632 国庫短期証券	日本	国債証券	420,000,000	100.00 420,013,300	100.00 420,013,300	- 2016/12/12	12.34
2	635 国庫短期証券	日本	国債証券	240,000,000	100.00 240,017,072	100.00 240,017,072	- 2016/12/26	7.05
3	630 国庫短期証券	日本	国債証券	100,000,000	100.00 100,001,370	100.00 100,001,370	- 2016/12/05	2.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	22.33%
合計	22.33%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2016年12月	買建	226	3,065,802,037	3,331,240,000	97.86%
		ミニTOPIX先物 2016年12月	買建	49	66,540,288	72,226,000	2.12%

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

#### 先進国株式マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成28年11月30日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	2,370,554,930	71.00
内 ドイツ	164,110,974	4.92
内 アメリカ	2,206,443,956	66.09
投資証券	669,639,876	20.06
内 アイルランド	373,970,666	11.20
内 アメリカ	295,669,210	8.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	298,404,656	8.94
純資産総額	3,338,599,462	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)	299,730,122	8.98
内 ドイツ	287,342,843	8.61
内 アメリカ	12,387,279	0.37
為替予約取引(買建)	172,722,176	5.17
内 日本	172,722,176	5.17



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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年11月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	81,000	23,987.39 1,942,984,145	24,834.70 2,011,610,878	60.25
2	ISHARES MSCI EUROPE	アイルランド	投資証券	146,540	2,523.39 369,796,370	2,552.00 373,970,666	11.20
3	ISHARES CORE S&P 500 ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	7,800	24,389.85 190,241,367	24,978.59 194,833,078	5.84
4	ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	ドイツ	投資信託 受益証券	40,100	4,044.18 162,175,352	4,092.54 164,110,974	4.92
5	ISHARES MSCI PACIFIC EX JAPA	アメリカ	投資証券	35,160	4,594.26 161,537,427	4,648.56 163,443,616	4.90
6	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	投資証券	45,500	2,836.35 129,058,324	2,906.05 132,225,594	3.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	71.00%
投資証券	20.06%
合計	91.06%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2016年12月	買建	1	12,030,654	12,387,279	0.37%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 IND 2016年12月	買建	141	285,401,129	287,342,843	8.61%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2016年12 月	買建	1,443,200	165,667,980	172,722,176	5.17%

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

- (注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
- (注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
- (注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 新興国株式マザーファンド

## (1) 投資状況 (平成28年11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	4,990,722,849	80.49
内 韓国	839,926,703	13.55
内 中国	1,611,369,271	25.99
内 台湾	532,660,466	8.59
内 タイ	124,631,741	2.01
内 マレーシア	143,895,212	2.32
内 フィリピン	70,799,940	1.14
内 インドネシア	144,887,106	2.34
内 ポーランド	60,557,949	0.98
内 ロシア	226,367,311	3.65
内 ハンガリー	18,076,381	0.29
内 ギリシャ	8,298,035	0.13
内 トルコ	57,440,009	0.93
内 チェコ	7,740,967	0.12
内 メキシコ	198,274,586	3.20
内 コロンビア	21,549,190	0.35
内 ベルギー	22,880,169	0.37
内 チリ	66,837,807	1.08
内 ブラジル	443,648,493	7.16
内 エジプト	12,191,689	0.20
内 南アフリカ	378,689,824	6.11
投資信託受益証券	115,315,707	1.86
内 アメリカ	115,315,707	1.86
投資証券	385,245,721	6.21
内 トルコ	3,212,235	0.05
内 アメリカ	351,465,166	5.67
内 メキシコ	6,987,173	0.11
内 南アフリカ	23,581,147	0.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	709,196,457	11.44
純資産総額	6,200,480,734	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)	706,961,489	11.40
内 シンガポール	682,757,463	11.01
内 アメリカ	24,204,026	0.39

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

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

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

## (2) 投資資産 (平成28年11月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数業種は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	投資証券	-	72,400	4,641.70 336,067,199	4,848.67 351,044,041	5.66
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	1,336	126,103.67 168,474,516	161,830.50 216,205,548	3.49
3	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	75,300	2,268.17 170,793,880	2,798.50 210,727,050	3.40
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	253,000	526.66 133,246,045	642.46 162,542,380	2.62
5	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	株式	情報技術	15,100	9,225.97 139,313,275	10,678.77 161,249,515	2.60
6	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	5,904	15,830.33 93,462,312	16,775.10 99,040,190	1.60
7	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	1,170,000	70.29 82,261,614	84.53 98,905,950	1.60
8	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	電気通信 サービス	81,000	1,245.85 100,914,372	1,218.00 98,658,000	1.59
9	BAIDU INC - SPON ADR	中国	株式	情報技術	3,600	19,894.29 71,619,841	19,019.21 68,469,176	1.10
10	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	975,000	58.47 57,017,545	69.31 67,577,250	1.09
11	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	1,049,000	44.03 46,203,972	50.89 53,388,855	0.86
12	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	-	29,334	1,877.41 55,072,062	1,788.60 52,466,857	0.85
13	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	-	25,600	2,111.24 54,047,939	2,006.69 51,371,443	0.83
14	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	42,823	918.98 39,354,326	1,150.58 49,271,664	0.79
15	GAZPROM PAO -SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	88,851	529.04 47,008,603	508.13 45,148,605	0.73
16	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	71,500	504.44 36,068,149	623.50 44,580,250	0.72

17	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	146,520	241.63 35,404,544	289.46 42,411,679	0.68
18	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	36,830	869.34 32,021,797	1,108.68 40,832,907	0.66
19	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	37,400	865.88 32,384,288	962.46 35,996,273	0.58
20	AMBEV SA	ブラジル	株式	生活必需品	62,700	624.61 39,163,340	565.02 35,427,205	0.57
21	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	245,000	132.25 32,402,429	143.69 35,205,275	0.57
22	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国	株式	金融	105,000	247.34 25,971,266	322.62 33,875,625	0.55
23	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	6,213	4,478.58 27,825,865	5,427.07 33,718,420	0.54
24	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	7,924	2,617.60 20,741,888	4,091.60 32,421,838	0.52
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	韓国	株式	情報技術	243	102,205.65 24,835,975	124,678.00 30,296,754	0.49
26	NAVER CORP	韓国	株式	情報技術	389	65,812.68 25,601,134	77,296.50 30,068,339	0.48
27	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	電気通信サービス	438,900	62.53 27,445,894	67.19 29,493,422	0.48
28	NETEASE INC-ADR	中国	株式	情報技術	1,100	17,553.93 19,309,372	25,861.09 28,447,206	0.46
29	JD.COM INC-ADR	中国	株式	一般消費財・サービス	9,000	2,777.78 25,000,985	3,018.47 27,166,293	0.44
30	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	中国	株式	一般消費財・サービス	5,100	5,112.74 26,075,245	5,156.70 26,299,198	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	80.49%
投資信託受益証券	1.86%
投資証券	6.21%
合計	88.56%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.54%
素材	5.72%
資本財・サービス	4.43%
一般消費財・サービス	8.64%
生活必需品	6.12%
ヘルスケア	1.58%
金融	19.58%
情報技術	19.27%
電気通信サービス	4.88%
公益事業	2.28%

不動産	1.45%
合計	80.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MINI MSCI EMG MKT 2016 年12月	買建	5	24,164,398	24,204,026	0.39%
	シンガポ ール	SGX MSCI TAIWAN 2016年 12月	買建	52	200,366,166	201,272,271	3.25%
		SGX CNX NIFTY ETS 2016 年12月	買建	262	473,665,144	481,485,192	7.77%

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

(注2) 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。

#### 国内債券マザーファンド

##### (1) 投資状況（平成28年11月30日現在）

###### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	10,113,339,300	99.04
内 日本	10,113,339,300	99.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	98,424,449	0.96
純資産総額	10,211,763,749	100.00

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

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

##### (2) 投資資産（平成28年11月30日現在）

###### 投資有価証券の主要銘柄

###### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	128 5年国債	日本	国債証券	154,000,000	101.26 155,942,720	100.93 155,441,440	0.100000 2021/06/20	1.52
2	305 10年国債	日本	国債証券	141,000,000	104.81 147,795,100	104.40 147,216,690	1.300000 2019/12/20	1.44
3	332 10年国債	日本	国債証券	134,000,000	105.59 141,491,660	104.67 140,260,480	0.600000 2023/12/20	1.37

4	309 10年国債	日本	国債証券	128,000,000	104.71 134,036,240	104.36 133,587,200	1.100000 2020/06/20	1.31
5	368 2年国債	日本	国債証券	132,000,000	100.65 132,863,270	100.50 132,661,320	0.100000 2018/09/15	1.30
6	340 10年国債	日本	国債証券	125,000,000	104.85 131,070,590	103.61 129,513,750	0.400000 2025/09/20	1.27
7	328 10年国債	日本	国債証券	120,000,000	104.94 125,929,320	104.30 125,162,400	0.600000 2023/03/20	1.23
8	117 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	101.29 121,548,000	100.85 121,022,400	0.200000 2019/03/20	1.19
9	342 10年国債	日本	国債証券	116,000,000	101.53 117,775,330	100.92 117,077,640	0.100000 2026/03/20	1.15
10	126 5年国債	日本	国債証券	113,000,000	101.29 114,463,130	100.87 113,987,620	0.100000 2020/12/20	1.12
11	289 10年国債	日本	国債証券	110,000,000	101.89 112,084,350	101.83 112,018,500	1.500000 2017/12/20	1.10
12	333 10年国債	日本	国債証券	106,000,000	105.55 111,886,800	104.75 111,044,540	0.600000 2024/03/20	1.09
13	123 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	101.06 111,171,780	100.77 110,854,700	0.100000 2020/03/20	1.09
14	339 10年国債	日本	国債証券	104,000,000	104.51 108,693,730	103.55 107,693,040	0.400000 2025/06/20	1.05
15	335 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	105.51 108,677,930	104.18 107,309,520	0.500000 2024/09/20	1.05
16	116 5年国債	日本	国債証券	105,000,000	101.19 106,249,500	100.77 105,809,550	0.200000 2018/12/20	1.04
17	109 5年国債	日本	国債証券	103,000,000	100.55 103,571,860	100.42 103,434,660	0.100000 2018/03/20	1.01
18	318 10年国債	日本	国債証券	98,000,000	106.10 103,981,940	105.28 103,174,400	1.000000 2021/09/20	1.01
19	325 10年国債	日本	国債証券	98,000,000	106.29 104,173,620	105.15 103,054,840	0.800000 2022/09/20	1.01
20	344 10年国債	日本	国債証券	102,000,000	101.22 103,246,120	100.83 102,847,620	0.100000 2026/09/20	1.01
21	343 10年国債	日本	国債証券	98,000,000	101.61 99,578,640	100.90 98,887,880	0.100000 2026/06/20	0.97
22	363 2年国債	日本	国債証券	95,000,000	100.65 95,619,400	100.42 95,403,750	0.100000 2018/04/15	0.93
23	312 10年国債	日本	国債証券	90,000,000	106.68 96,020,100	105.32 94,795,200	1.200000 2020/12/20	0.93
24	127 5年国債	日本	国債証券	88,000,000	101.53 89,348,480	100.90 88,797,280	0.100000 2021/03/20	0.87
25	122 5年国債	日本	国債証券	87,000,000	101.25 88,092,720	100.75 87,652,500	0.100000 2019/12/20	0.86
26	145 20年国債	日本	国債証券	70,000,000	124.66 87,264,470	122.94 86,060,100	1.700000 2033/06/20	0.84
27	322 10年国債	日本	国債証券	78,000,000	106.18 82,825,980	105.26 82,109,040	0.900000 2022/03/20	0.80
28	118 5年国債	日本	国債証券	81,000,000	101.09 81,887,340	100.93 81,755,730	0.200000 2019/06/20	0.80

29	148 20年国債	日本	国債証券	67,000,000	120.35 80,636,300	119.73 80,219,770	1.500000 2034/03/20	0.79
30	62 20年国債	日本	国債証券	75,000,000	106.62 79,965,810	105.75 79,317,750	0.800000 2023/06/20	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.04%
合計	99.04%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 先進国債券マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成28年11月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	1,414,345,853	98.03
内 ユーロ	570,775,459	39.56
内 シンガポール	4,925,359	0.34
内 マレーシア	3,697,344	0.26
内 ノルウェー	2,222,115	0.15
内 スウェーデン	5,439,699	0.38
内 デンマーク	8,455,395	0.59
内 イギリス	103,853,856	7.20
内 ポーランド	6,792,376	0.47
内 カナダ	30,116,183	2.09
内 アメリカ	633,088,191	43.88
内 メキシコ	9,762,877	0.68
内 南アフリカ	5,999,023	0.42
内 オーストラリア	29,217,976	2.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	28,460,631	1.97
純資産総額	1,442,806,484	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)	145,426,235	10.08
内 日本	145,426,235	10.08

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産（平成28年11月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	549,000	100.87 62,261,254	100.22 61,858,063	1.250000 2019/01/31	4.29
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	475,000	111.35 59,465,402	107.89 57,612,720	3.625000 2021/02/15	3.99
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	423,000	100.04 47,575,608	99.85 47,482,805	0.750000 2017/12/31	3.29
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	403,000	103.11 46,715,440	101.39 45,938,627	2.125000 2021/09/30	3.18
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	328,000	101.74 37,515,669	100.73 37,145,888	1.500000 2019/03/31	2.57
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	284,000	107.04 34,177,446	102.30 32,662,884	2.500000 2024/05/15	2.26
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	283,000	106.86 33,998,810	102.52 32,617,548	2.500000 2023/08/15	2.26
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	263,000	113.16 33,460,010	103.42 30,580,293	3.125000 2044/08/15	2.12
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	250,000	115.41 32,437,232	108.30 30,438,839	3.375000 2044/05/15	2.11
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	266,000	101.15 30,249,884	100.75 30,127,997	1.500000 2019/02/28	2.09
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	271,000	100.51 30,623,279	97.84 29,808,672	1.625000 2022/11/15	2.07
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	263,000	100.26 29,645,852	99.21 29,335,250	1.125000 2019/12/31	2.03
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	259,000	101.11 29,442,639	100.75 29,335,155	1.500000 2018/08/31	2.03
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	240,000	101.04 27,263,019	99.53 26,856,418	1.375000 2020/05/31	1.86
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	188,000	111.86 25,172,990	111.34 25,056,183	2.500000 2020/10/25	1.74
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	209,000	103.04 24,210,087	101.20 23,779,374	1.875000 2020/06/30	1.65
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	186,000	104.22 23,203,751	104.08 23,173,692	1.000000 2019/05/25	1.61



18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	133,000	141.45 21,150,681	136.12 20,353,219	6.125000 2027/11/15	1.41
19	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	162,000	101.49 19,681,671	101.44 19,670,830	0.250000 2018/04/13	1.36
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	171,000	105.20 20,224,212	100.18 19,259,768	2.250000 2024/11/15	1.33
21	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	149,000	108.58 19,366,525	107.25 19,129,607	3.750000 2018/10/31	1.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	118,000	140.55 18,644,913	137.32 18,216,266	6.500000 2026/11/15	1.26
23	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	120,000	125.34 18,005,001	121.82 17,499,373	4.750000 2023/08/01	1.21
24	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	125,000	114.00 17,057,975	113.25 16,945,629	2.250000 2021/09/04	1.17
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	150,000	103.50 17,453,414	98.63 16,632,314	2.875000 2043/05/15	1.15
26	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	78,000	156.35 17,130,368	150.70 16,510,511	4.500000 2042/12/07	1.14
27	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	109,000	124.66 16,265,697	121.92 15,908,442	5.500000 2021/04/30	1.10
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	78,000	161.43 15,072,665	158.93 14,839,031	4.750000 2035/04/25	1.03
29	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	114,000	110.78 15,118,034	108.52 14,808,422	4.250000 2019/02/01	1.03
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	103,000	123.26 15,197,996	119.56 14,740,671	2.500000 2030/05/25	1.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.03%
合計	98.03%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2016年12月	買建	76,000	6,245,347	6,392,920	0.44%
		カナダ・ドル買/円売 2016年12月	買建	81,000	6,606,722	6,776,730	0.47%
		スイス・フラン買/円売 2016年12月	買建	28,400	3,011,548	3,155,524	0.22%

デンマーク・クローネ買/円売 2016年12月	買建	80,000	1,276,896	1,286,400	0.09%
ユーロ買/円売 2016年12月	買建	441,000	52,398,894	52,783,290	3.66%
英ポンド買/円売 2016年12月	買建	70,000	9,717,470	9,831,500	0.68%
南アフリカ・ランド買/円売 2016年12月	買建	140,000	1,111,782	1,131,200	0.08%
ノルウェー・クローネ買/円売 2016年12月	買建	96,580	1,223,228	1,271,961	0.09%
ポーランド・ズロチ買/円売 2016年12月	買建	46,000	1,228,791	1,240,620	0.09%
スウェーデン・クローネ買/円売 2016年12月	買建	80,000	972,128	980,000	0.07%
シンガポール・ドル買/円売 2016年12月	買建	7,000	550,426	552,510	0.04%
米ドル買/円売 2016年12月	買建	518,000	58,000,038	58,228,380	4.04%
メキシコ・ペソ買/円売 2016年12月	買建	330,000	1,782,682	1,795,200	0.12%

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

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 新興国債券マザーファンド

### (1) 投資状況 (平成28年11月30日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	5,270,449,867	96.70
内 アメリカ	5,270,449,867	96.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	179,877,091	3.30
純資産総額	5,450,326,958	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)	78,680,000	1.44
内 日本	78,680,000	1.44

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

### (2) 投資資産 (平成28年11月30日現在)

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数種類は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	1,607,140	122.09 220,592,718	120.63 217,949,665	7.500000 2030/03/31	4.00

2	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	750,000	113.04 95,309,676	102.75 86,633,662	7.500000 2026/04/22	1.59
3	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	480,000	150.32 81,117,232	146.51 79,060,219	8.280000 2033/12/31	1.45
4	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	634,000	107.14 76,363,533	100.10 71,345,554	4.000000 2023/10/02	1.31
5	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	710,000	101.00 80,616,382	89.25 71,237,743	4.750000 2044/03/08	1.31
6	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	600,000	106.43 71,791,861	105.51 71,174,001	5.000000 2020/04/29	1.31
7	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	555,000	117.77 73,484,721	113.68 70,934,091	11.000000 2018/07/24	1.30
8	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	109.20 73,657,584	105.05 70,858,326	6.875000 2021/04/22	1.30
9	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	350,000	176.58 69,479,663	168.80 66,418,129	12.750000 2028/06/24	1.22
10	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	570,000	112.62 72,169,424	100.12 64,159,499	5.550000 2045/01/21	1.18
11	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	600,000	96.26 64,933,792	94.62 63,826,455	4.250000 2025/01/07	1.17
12	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	104.10 70,217,532	87.37 58,936,185	4.600000 2046/01/23	1.08
13	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	330,000	171.39 63,583,313	158.75 58,897,366	9.500000 2030/02/02	1.08
14	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	353,000	154.08 61,146,643	147.75 58,633,494	8.750000 2033/11/21	1.08
15	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	820,000	63.69 58,716,966	61.00 56,232,484	2.500000 2038/12/31	1.03
16	Hungary Government International Bond	アメリカ	国債証券	442,000	114.05 56,671,034	112.63 55,967,926	6.375000 2021/03/29	1.03
17	Indonesia Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	129.76 58,351,825	124.20 55,852,054	6.750000 2044/01/15	1.02
18	Brazilian Government International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	90.18 60,830,462	80.25 54,130,230	5.000000 2045/01/27	0.99
19	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	450,000	107.20 54,231,408	105.15 53,194,333	6.250000 2019/04/22	0.98
20	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	422,000	123.12 58,410,902	107.02 50,773,987	6.050000 2040/01/11	0.93
21	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	410,000	120.12 55,369,064	110.04 50,722,622	7.375000 2025/02/05	0.93
22	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	450,000	114.35 57,848,521	97.25 49,197,802	7.625000 2046/04/22	0.90
23	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	420,000	103.07 48,666,618	103.15 48,703,716	4.875000 2021/01/22	0.89
24	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	156.12 52,653,031	143.02 48,235,599	7.750000 2031/01/14	0.89
25	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	416,000	117.28 54,850,842	102.95 48,150,079	6.875000 2036/03/17	0.88
26	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	400,000	108.74 48,898,203	107.05 48,138,244	5.875000 2019/01/15	0.88

27	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	400,000	114.10 51,308,488	106.24 47,776,701	5.625000 2042/04/04	0.88
28	Indonesia Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	109.54 49,258,621	106.21 47,760,512	4.875000 2021/05/05	0.88
29	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	400,000	106.73 47,994,796	105.46 47,425,950	4.875000 2023/09/16	0.87
30	Indonesia Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	142.53 48,070,229	140.28 47,313,868	8.500000 2035/10/12	0.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.70%
合計	96.70%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2016年12月	買建	700,000	78,673,000	78,680,000	1.44%

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

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

## (参考情報) 運用実績

2016年11月30日現在  
基準価額・純資産の推移

※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	11,379円
純資産総額	67百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	3.2%
6カ月間	0.3%
1年間	-7.2%
3年間	5.6%
5年間	-
設定来	13.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 14年5月	第2期 15年5月	第3期 16年5月					
分配金	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

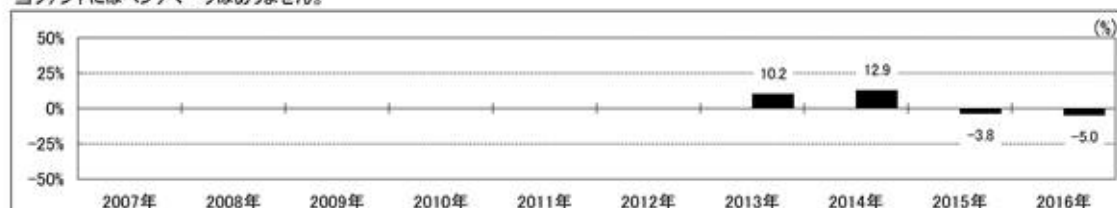
※比率は、純資産総額に対するものです。

マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
先進国債券MF	16.6%	外国債券	283	32.2%	米ドル	39.8%	TOPIX先物 2812月	日本	16.2%
国内株式MF	16.6%	国内債券	249	20.0%	日本円	34.0%	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	9.9%
先進国株式MF	16.5%	外国株式・先物	616	16.6%	ユーロ	10.7%	ISHARES MSCI EUROPE	アイルランド	1.8%
国内債券MF	16.5%	国内株式・先物	2	16.6%	香港ドル	3.4%	STOXX EUROPE 600 IND 201612	ドイツ	1.4%
新興国株式MF	16.5%	外国投資信託等	12	16.3%	韓国ウォン	2.5%	SGX CNX NIFTY ETS 201612	インド	1.3%
新興国債券MF	16.5%	外国リート	7	0.1%	台湾ドル	2.0%	ISHARES CORE S&P 500 ETF	アメリカ	1.0%
					南アフリカ・ランド	1.3%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	0.9%
					英ポンド	1.2%	ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	ドイツ	0.8%
					ブラジル・レアル	1.2%	ISHARES MSCI PACIFIC EX JAPA	アメリカ	0.8%
		コール・ローン、その他		18.1%	その他	4.0%	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	0.7%
合計	99.1%	合計	1,169	-	合計	100.0%	合計		34.9%

※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。

・2013年は設定日(6月10日)から年末、2016年は11月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年5月10日から平成28年11月9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。

スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		16,410,674
親投資信託受益証券		46,974,026
流動資産合計		63,384,700
資産合計		63,384,700
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		17,057
未払委託者報酬		444,753
その他未払費用		2,474
流動負債合計		464,284
負債合計		464,284
純資産の部		
元本等		
元本	1	58,001,071
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		4,919,345
（分配準備積立金）		4,771,445
元本等合計		62,920,416
純資産合計		62,920,416
負債純資産合計		63,384,700

[次へ](#)

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日 金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	825,287
営業収益合計	825,287
営業費用	
支払利息	4,011
受託者報酬	17,057
委託者報酬	444,753
その他費用	2,477
営業費用合計	468,298
営業損失( )	1,293,585
経常損失( )	1,293,585
中間純損失( )	1,293,585
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	7,087
期首剰余金又は期首欠損金( )	6,092,635
剰余金増加額又は欠損金減少額	242,666
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	242,666
剰余金減少額又は欠損金増加額	115,284
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	115,284
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,919,345

[次へ](#)



## (3) 中間注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成28年11月9日現在
1. 1期首元本額	56,667,386円
期中追加設定元本額	2,405,980円
期中一部解約元本額	1,072,295円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	58,001,071口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
	該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成28年11月9日現在
	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成28年11月9日現在
1口当たり純資産額	1.0848円

(1万口当たり純資産額)

(10,848円)

(参考)

当ファンドは、「国内株式マザーファンド」受益証券、「先進国株式マザーファンド」受益証券、「新興国株式マザーファンド」受益証券、「国内債券マザーファンド」受益証券、「先進国債券マザーファンド」受益証券及び「新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの中間計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

## 「国内株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,982,159,134
国債証券		680,026,560
差入委託証拠金		135,831,000
流動資産合計		3,798,016,694
資産合計		3,798,016,694
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		141,714,285
前受金		31,431,750
未払金		530,024,560
未払解約金		8,510,000
流動負債合計		711,680,595
負債合計		711,680,595
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,529,354,274
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		556,981,825
元本等合計		3,086,336,099
純資産合計		3,086,336,099
負債純資産合計		3,798,016,694

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年11月9日現在
1. 1 期首	平成28年5月10日
期首元本額	656,469,906円
期中追加設定元本額	2,602,337,074円
期中一部解約元本額	729,452,706円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6 資産（為替ヘッジなし）資 金拠出用ファンド（適格機関 投資家専用）	9,593,298円
ダイナミック・アロケーショ ン・ファンド（適格機関投資 家専用）	1,881,135,769円
国内株式ファンド（適格機関 投資家専用）	318,059,895円
スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジあり）	15,477,943円
スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし）	6,284,671円
スマート・アロケーション・ Dガード	1,923,788円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	66,039,038円
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	13,643,853円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	2,552,381円
（適格機関投資家専用）ス mart・シックス・Dガード	61,523,877円
ダイワ・ダブルバランス・ ファンド（Dガード付/部分 為替ヘッジあり）	2,786,532円
ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジあり）	75,031,728円
ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジなし）	75,229,821円
DCスマート・アロケーショ ン・Dガード	71,680円
計	2,529,354,274円
2. 期末日における受益権の総数	2,529,354,274口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成28年11月9日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	3,529,290,000	-	3,387,720,000	141,570,000
合計	3,529,290,000	-	3,387,720,000	141,570,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成28年11月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2202円 (12,202円)

[次へ](#)

## 「先進国株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		6,701,906
コール・ローン		204,498,054
投資信託受益証券		2,213,945,559
投資証券		667,293,136
派生商品評価勘定		596,204
差入委託証拠金		93,658,427
流動資産合計		3,186,693,286
資産合計		3,186,693,286
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		7,493,552
未払解約金		3,153,000
流動負債合計		10,646,552
負債合計		10,646,552
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,483,976,779
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		692,069,955
元本等合計		3,176,046,734
純資産合計		3,176,046,734
負債純資産合計		3,186,693,286

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9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。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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、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	平成28年11月9日現在
1. 1 期首	平成28年5月10日
期首元本額	519,875,772円
期中追加設定元本額	2,543,546,675円
期中一部解約元本額	579,445,668円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6 資産（為替ヘッジなし）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	9,460,375円
ダイナミック・アロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	1,990,957,349円
先進国株式ファンド（適格機関投資家専用）	319,266,210円

スマート・ミックス・Dガード(為替ヘッジなし)	6,129,322円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	66,963,591円
堅実バランスファンド - ハジメの一步 -	13,608,390円
DCダイナミック・アロケーション・ファンド	2,583,773円
ダイワ6資産バランス・ファンド(Dガード付/為替ヘッジなし)	75,007,769円
計	2,483,976,779円
2. 期末日における受益権の総数	2,483,976,779口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	平成28年11月9日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	289,103,328	-	285,416,111	3,687,217
合計	289,103,328	-	285,416,111	3,687,217

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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



## 2. 通貨関連

種 類	平成28年11月9日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	191,923,478	-	188,713,347	3,210,131
アメリカ・ドル	1,989,462	-	2,030,795	41,333
ユーロ	189,934,016	-	186,682,552	3,251,464
合計	191,923,478	-	188,713,347	3,210,131

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成28年11月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2786円 (12,786円)

[次へ](#)

## 「新興国株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		539,884,715
コール・ローン		7,920,260
株式		4,770,640,869
投資信託受益証券		106,467,761
投資証券		377,078,972
派生商品評価勘定		50,088
未収入金		1,878,859
未収配当金		3,622,213
差入委託証拠金		118,193,873
流動資産合計		5,925,737,610
資産合計		5,925,737,610
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		13,764,945
未払解約金		2,211,950
その他未払費用		87,172
流動負債合計		16,064,067
負債合計		16,064,067
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,749,428,850
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		160,244,693
元本等合計		5,909,673,543
純資産合計		5,909,673,543
負債純資産合計		5,925,737,610

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

	<p>(2)投資信託受益証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。  時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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>(3)投資証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。  時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。  時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。  時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金  原則として、株式、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  外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年11月9日現在
1. 1 期首 期首元本額	平成28年5月10日 6,006,654,818円

期中追加設定元本額	774,664,441円
期中一部解約元本額	1,031,890,409円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6資産（為替ヘッジなし）資 金拠出用ファンド（適格機関 投資家専用）	9,900,000円
ダイワ新興国株式ファンド （FOFs用）（適格機関投資家 専用）	5,157,886,118円
新興国株式ファンド（適格機 関投資家専用）	398,171,766円
スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし）	7,761,277円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	62,675,388円
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	16,918,813円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	2,423,835円
ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジなし）	93,691,653円
計	5,749,428,850円
2. 期末日における受益権の総数	5,749,428,850口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	平成28年11月9日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	666,565,375	-	652,850,518	13,714,857

合計	666,565,375	-	652,850,518	13,714,857
----	-------------	---	-------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	平成28年11月9日現在	
1口当たり純資産額		1.0279円
(1万口当たり純資産額)		(10,279円)

[次へ](#)

## 「国内債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		104,660,442
国債証券		8,571,101,380
未収利息		10,084,890
前払費用		9,568,932
流動資産合計		8,695,415,644
資産合計		8,695,415,644
負債の部		
流動負債		
未払解約金		60,183,000
流動負債合計		60,183,000
負債合計		60,183,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	7,702,762,763
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		932,469,881
元本等合計		8,635,232,644
純資産合計		8,635,232,644
負債純資産合計		8,695,415,644

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年11月9日現在
1. 1 期首	平成28年5月10日
期首元本額	4,443,536,443円
期中追加設定元本額	7,178,538,365円
期中一部解約元本額	3,919,312,045円
期末元本額の内訳	

ファンド名	
6 資産（為替ヘッジなし）資 金拠出用ファンド（適格機関 投資家専用）	9,900,000円
ダイナミック・アロケーショ ン・ファンド（適格機関投資 家専用）	6,458,835,812円
スマート・ミックス・Dガー ド(為替ヘッジあり)	17,654,544円
スマート・ミックス・Dガー ド(為替ヘッジなし)	7,042,515円
スマート・アロケーション・ Dガード	14,648,900円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	315,535,406円
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	250,118,496円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	12,263,535円
（適格機関投資家専用）ス マート・シックス・Dガード	422,180,993円
ダイワ・ダブルバランス・ ファンド（Dガード付/部分 為替ヘッジあり）	21,060,261円
ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジあり）	86,890,758円
ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジなし）	86,084,015円
DCスマート・アロケーショ ン・Dガード	547,528円
計	7,702,762,763円
2. 期末日における受益権の総数	7,702,762,763口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成28年11月9日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

平成28年11月9日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1211円 (11,211円)
---------------------------	----------------------

[次へ](#)



## 「先進国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		2,313,682
コール・ローン		72,334,253
国債証券		1,767,454,131
未収入金		3,794
未収利息		12,057,641
前払費用		2,772,045
流動資産合計		1,856,935,546
資産合計		1,856,935,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		258,638
未払金		56,484
未払解約金		60,757,000
流動負債合計		61,072,122
負債合計		61,072,122
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,692,342,165
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		103,521,259
元本等合計		1,795,863,424
純資産合計		1,795,863,424
負債純資産合計		1,856,935,546

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p>

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年11月9日現在
<p>1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額</p>	<p>平成28年5月10日 1,031,984,827円 1,785,539,323円 1,125,181,985円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名 6資産（為替ヘッジなし）資 金拠出用ファンド（適格機関 投資家専用） スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし） スマート・アロケーション・ Dガード 堅実バランスファンド - ハジ メの一步 - （適格機関投資家専用）ス マート・シックス・Dガード ダイワ・ダブルバランス・ ファンド（Dガード付/部分 為替ヘッジあり） ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジなし） DCスマート・アロケーシ ョン・Dガード</p> <p>計</p>	<p>14,850,000円 7,278,576円 49,786,259円 24,297,169円 1,433,689,580円 71,618,766円 88,960,686円 1,861,129円</p> <p>1,692,342,165円</p>
<p>2. 期末日における受益権の総数</p>	<p>1,692,342,165口</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
<p>1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額</p>	<p>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。</p>
<p>2. 金融商品の時価の算定方法</p>	<p>(1)有価証券</p>

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)デリバティブ取引  
デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）  
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種 類	平成28年11月9日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	14,333,734	-	14,075,096	258,638
スイス・フラン	4,390,073	-	4,318,434	71,639
スウェーデン・ クローナ	1,797,493	-	1,760,800	36,693
デンマーク・ クローネ	1,391,688	-	1,360,800	30,888
ノルウェー・ クローネ	2,996,382	-	2,928,862	67,520
ポーランド・ ズロチ	1,598,556	-	1,555,800	42,756
南アフリカ・ ランド	2,159,542	-	2,150,400	9,142
合計	14,333,734	-	14,075,096	258,638

#### （注） 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

#### （1口当たり情報）

	平成28年11月9日現在
--	--------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0612円 (10,612円)
---------------------------	----------------------

[次へ](#)

## 「新興国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月9日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		6,415,951
コール・ローン		13,972,818
国債証券		5,131,936,128
未収利息		61,124,065
前払費用		7,146,762
流動資産合計		5,220,595,724
資産合計		5,220,595,724
負債の部		
流動負債		
未払解約金		3,720,000
流動負債合計		3,720,000
負債合計		3,720,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,328,422,357
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		888,453,367
元本等合計		5,216,875,724
純資産合計		5,216,875,724
負債純資産合計		5,220,595,724

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年5月10日 至 平成28年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年11月9日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額  期末元本額の内訳 ファンド名 6 資産（為替ヘッジなし）資 金拠出用ファンド（適格機関 投資家専用） ダイワ米ドル建て新興国債券 ファンドM（FOFs用）（適格 機関投資家専用） 新興国債券（為替ヘッジあ り）ファンド（適格機関投資 家専用） スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし） リそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド 堅実バランスファンド - ハジ メの一步 - DCダイナミック・アロケー ション・ファンド ダイワ6資産バランス・ファ ンド（Dガード付/為替ヘッ ジなし）  計	平成28年5月10日 3,652,891,489円 1,960,898,782円 1,285,367,914円  29,296,871円 2,433,887,158円 1,687,539,113円 6,530,588円 67,777,612円 21,616,792円 2,620,897円 79,153,326円  4,328,422,357円  4,328,422,357円
2. 期末日における受益権の総数	4,328,422,357口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年11月9日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成28年11月9日 現在

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年11月9日現在

1口当たり純資産額	1.2053円
（1万口当たり純資産額）	（12,053円）

## 2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成28年11月30日

資産総額	67,194,369円
負債総額	55,074円
純資産総額（ - ）	67,139,295円
発行済数量	59,003,730口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1379円

(参考) 国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	3,777,629,153円
負債総額	373,369,600円
純資産総額（ - ）	3,404,259,553円
発行済数量	2,451,863,532口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3884円

(参考) 先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	3,364,548,921円
負債総額	25,949,459円
純資産総額（ - ）	3,338,599,462円
発行済数量	2,333,204,154口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4309円

(参考) 新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	6,218,886,642円
負債総額	18,405,908円



純資産総額（ - ）	6,200,480,734円
発行済数量	5,779,119,770口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0729円

## (参考) 国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	10,321,414,509円
負債総額	109,650,760円
純資産総額（ - ）	10,211,763,749円
発行済数量	9,197,069,040口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1103円

## (参考) 先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	1,572,002,937円
負債総額	129,196,453円
純資産総額（ - ）	1,442,806,484円
発行済数量	1,278,865,456口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1282円

## (参考) 新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年11月30日

資産総額	5,495,791,358円
負債総額	45,464,400円
純資産総額（ - ）	5,450,326,958円
発行済数量	4,335,604,958口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2571円

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

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

<訂正後>

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成28年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

##### ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

##### ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成28年11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	66	217,791
追加型株式投資信託	673	12,472,436
株式投資信託 合計	739	12,690,227
単位型公社債投資信託	12	87,699
追加型公社債投資信託	14	2,003,979
公社債投資信託 合計	26	2,091,677
総合計	765	14,781,905

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

<訂正後>

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30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。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	243
建物	21	18

器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

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

純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14

その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-

その他	26	-
特別損失計	772	-
税引前当期純利益	19,651	19,471
法人税、住民税及び事業税	6,238	6,215
法人税等調整額	17	6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）



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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

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

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

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

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

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券



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

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

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

### (1株当たり情報)

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

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
固定資産		
有形固定資産	1	241
無形固定資産		
ソフトウェア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
投資その他の資産		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金		7,144
未払費用		3,762
未払法人税等		1,205
賞与引当金		733
その他	3	434
<b>流動負債合計</b>		<b>13,279</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金		2,301
役員退職慰労引当金		122
その他		9
<b>固定負債合計</b>		<b>2,432</b>
<b>負債合計</b>		<b>15,712</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金		15,174
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金		11,495
<b>資本剰余金合計</b>		<b>11,495</b>
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金		374
<b>その他利益剰余金</b>		
繰越利益剰余金		6,184
<b>利益剰余金合計</b>		<b>6,559</b>
<b>株主資本合計</b>		<b>33,229</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金		179
<b>評価・換算差額等合計</b>		<b>179</b>
<b>純資産合計</b>		<b>33,408</b>
<b>負債・純資産合計</b>		<b>49,121</b>

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	2	165
営業外費用	3	59
経常利益		8,290
特別利益		-
特別損失	4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		1,393
中間純利益		5,486

### (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）



	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	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
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

## 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

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

中間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とおりであります。

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。

ただし、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、支給見込額の当中間会計期間負担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中間会計期間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事業年度ごと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中間会計期間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中間会計期間末要支給額を計上しております。

## ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （１）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。

### （２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

### １ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

### ２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

## 3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## ( 中間損益計算書関係 )

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

## 4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
MMF等償還関連費用	260百万円

## ( 中間株主資本等変動計算書関係 )

当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 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

### 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (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

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

### 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,153	22,153	-
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	-
資産合計	38,186	38,186	-
(1) 未払金	7,144	7,144	-
(2) 未払費用(*)	3,762	3,762	-
負債合計	10,906	10,906	-

(\*) 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・預金及び(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) 未払金及び(2) 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	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間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	2,406	2,569	163
小計	2,406	2,569	163
合計	6,511	6,252	259

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

(セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

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 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

## 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中間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

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間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中間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、中間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 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30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 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

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 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

	当中間会計期間 ( 自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日 )
1 株当たり純資産額	12,807.54円
1 株当たり中間純利益金額	2,103.26円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間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株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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



## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月9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」に掲げられているスマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）の平成28年5月10日から平成28年11月9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、スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）の平成28年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年5月10日から平成28年11月9日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年11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	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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な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、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了す

る中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の経営成績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

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。