

**【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30年2月1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】** 高橋 慎  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【電話番号】** 03-5555-3431

**【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】** 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】

2017年8月1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（2017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2017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。



※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：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円ベース)

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●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、2017年11月末現在のものですので、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29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	64,532,251	99.11
内 日本	64,532,251	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	579,109	0.89
純資産総額	65,111,360	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成29年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	国内株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,329,208	1.5112 9,565,015	1.7231 10,905,858	16.75
2	先進国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,213,765	1.6089 9,997,407	1.7470 10,855,447	16.67
3	新興国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,891,540	1.3453 10,616,690	1.3608 10,738,807	16.49
4	先進国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,914,809	1.1569 10,313,579	1.2031 10,725,406	16.47
5	国内債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,689,484	1.1018 10,676,756	1.1028 10,685,562	16.41
6	新興国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,475,487	1.2379 9,254,245	1.4208 10,621,171	16.31

(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	99.11%
合計	99.11%

(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
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
平成28年11月末日	67,139,295	-	1.1379	-
12月末日	67,962,929	-	1.1743	-
平成29年1月末日	68,020,460	-	1.1715	-
2月末日	68,458,791	-	1.1815	-
3月末日	68,292,651	-	1.1858	-
4月末日	70,662,531	-	1.1926	-
第4計算期間末 (平成29年5月8日)	71,862,229	71,862,229	1.2113	1.2113
5月末日	69,744,760	-	1.2097	-
6月末日	69,909,837	-	1.2232	-
7月末日	72,803,825	-	1.2303	-
8月末日	70,748,999	-	1.2402	-
9月末日	65,411,908	-	1.2630	-
10月末日	65,621,827	-	1.2859	-
11月末日	65,111,360	-	1.2887	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
平成29年5月9日～ 平成29年11月8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
第4計算期間	9.4
平成29年5月9日～ 平成29年11月8日	7.4

## (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
第4計算期間	5,983,620	3,325,237
平成29年5月9日～ 平成29年11月8日	6,746,523	14,226,717

(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29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(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,956,138,257	100.00
純資産総額	4,956,138,257	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)	4,956,126,000	100.00
内 日本	4,956,126,000	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。

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

## (2) 投資資産（平成29年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

該当事項はありません。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

## 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	日本	TOPIX先物 2017年12月	買建	272	4,780,551,880	4,887,840,000	98.62%
		ミニTOPIX先物 2017年12 月	買建	38	66,924,354	68,286,000	1.38%

(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29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	3,359,916,574	68.92
内 ドイツ	691,582,615	14.19
内 アメリカ	2,668,333,959	54.74
投資証券	422,380,520	8.66
内 アメリカ	422,380,520	8.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,092,446,212	22.41
純資産総額	4,874,743,306	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)	1,091,571,330	22.39
内 ドイツ	576,841,642	11.83
内 アメリカ	514,729,688	10.56
為替予約取引(買建)	602,174,905	12.35
内 日本	602,174,905	12.35

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

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

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

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

## (2) 投資資産（平成29年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	ISHARES CORE S&P 500 ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	90,040	28,433.92 2,560,198,260	29,634.98 2,668,333,959	54.74
2	ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	ドイツ	投資信託 受益証券	136,210	5,109.86 696,016,498	5,077.32 691,582,615	14.19
3	ISHARES MSCI PACIFIC EX JAPA	アメリカ	投資証券	44,060	5,241.69 230,951,442	5,336.94 235,145,642	4.82
4	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	投資証券	57,900	3,204.85 185,565,859	3,233.76 187,234,878	3.84

(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	68.92%
投資証券	8.66%
合計	77.59%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2017年12月	買建	35	506,746,965	514,729,688	10.56%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 IND 2017年12月	買建	224	579,450,561	576,841,642	11.83%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2017年12 月	買建	2,167,700	245,875,657	242,630,661	4.98%
		ユーロ買/円売 2017年12 月	買建	2,706,800	358,473,799	359,544,244	7.38%

(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29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(%)
投資証券	300,911,396	37.53
内 アメリカ	300,911,396	37.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	500,784,182	62.47
純資産総額	801,695,578	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)	501,020,370	62.50
内 アメリカ	501,020,370	62.50

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

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

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

## (2) 投資資産（平成29年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	-	47,700	5,966.66 284,620,592	6,308.41 300,911,396	37.53
2	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	中国	株式	その他	49,000	0.00 0	0.00 0	0.00
3	HANERGY THIN FILM POWER GROU	中国	株式	情報技術	172,000	56.10 9,650,662	0.00 0	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	37.53%
合計	37.53%

(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	MINI MSCI EMG MKT 2017年12月	買建	79	481,387,025	501,020,370	62.50%

(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29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	15,199,047,540	99.33
内 日本	15,199,047,540	99.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	102,234,815	0.67
純資産総額	15,301,282,355	100.00

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

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

### (2) 投資資産（平成29年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	117 5年国債	日本	国債証券	266,000,000	100.51 267,358,240	100.45 267,202,320	0.200000 2019/03/20	1.75
2	325 10年国債	日本	国債証券	255,000,000	104.49 266,473,500	104.38 266,184,300	0.800000 2022/09/20	1.74
3	332 10年国債	日本	国債証券	215,000,000	104.15 223,927,400	104.16 223,946,150	0.600000 2023/12/20	1.46
4	122 5年国債	日本	国債証券	222,000,000	100.63 223,405,600	100.50 223,114,440	0.100000 2019/12/20	1.46
5	123 5年国債	日本	国債証券	220,000,000	100.70 221,561,000	100.56 221,238,600	0.100000 2020/03/20	1.45
6	343 10年国債	日本	国債証券	206,000,000	100.84 207,749,160	100.98 208,024,980	0.100000 2026/06/20	1.36
7	127 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	100.80 201,603,800	100.77 201,552,000	0.100000 2021/03/20	1.32
8	125 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.78 191,499,200	100.68 191,305,300	0.100000 2020/09/20	1.25
9	126 5年国債	日本	国債証券	189,000,000	100.71 190,355,100	100.71 190,357,020	0.100000 2020/12/20	1.24
10	338 10年国債	日本	国債証券	171,000,000	103.37 176,770,010	103.40 176,824,260	0.400000 2025/03/20	1.16
11	334 10年国債	日本	国債証券	165,000,000	104.58 172,562,390	104.43 172,321,050	0.600000 2024/06/20	1.13
12	340 10年国債	日本	国債証券	164,000,000	103.41 169,600,100	103.44 169,641,600	0.400000 2025/09/20	1.11

13	128 5年国債	日本	国債証券	164,000,000	100.79 165,304,810	100.81 165,341,520	0.100000 2021/06/20	1.08
14	312 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	104.35 162,795,260	104.06 162,339,840	1.200000 2020/12/20	1.06
15	130 5年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.87 161,396,100	100.93 161,494,400	0.100000 2021/12/20	1.06
16	118 5年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.60 160,971,800	100.54 160,865,600	0.200000 2019/06/20	1.05
17	341 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	102.54 159,963,650	102.66 160,149,600	0.300000 2025/12/20	1.05
18	344 10年国債	日本	国債証券	158,000,000	100.87 159,387,120	100.92 159,458,340	0.100000 2026/09/20	1.04
19	329 10年国債	日本	国債証券	143,000,000	105.33 150,631,680	104.98 150,129,980	0.800000 2023/06/20	0.98
20	346 10年国債	日本	国債証券	147,000,000	100.71 148,056,200	100.78 148,158,360	0.100000 2027/03/20	0.97
21	328 10年国債	日本	国債証券	141,000,000	103.82 146,393,170	103.72 146,248,020	0.600000 2023/03/20	0.96
22	322 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	104.50 135,857,400	104.42 135,747,300	0.900000 2022/03/20	0.89
23	320 10年国債	日本	国債証券	128,000,000	104.61 133,904,640	104.55 133,825,280	1.000000 2021/12/20	0.87
24	345 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.60 130,781,820	100.85 131,115,400	0.100000 2026/12/20	0.86
25	305 10年国債	日本	国債証券	126,000,000	103.26 130,110,750	102.96 129,732,120	1.300000 2019/12/20	0.85
26	330 10年国債	日本	国債証券	121,000,000	105.24 127,347,940	105.18 127,272,640	0.800000 2023/09/20	0.83
27	306 10年国債	日本	国債証券	120,000,000	103.69 124,429,200	103.53 124,245,600	1.400000 2020/03/20	0.81
28	347 10年国債	日本	国債証券	123,000,000	100.44 123,547,900	100.76 123,936,030	0.100000 2027/06/20	0.81
29	348 10年国債	日本	国債証券	123,000,000	100.49 123,605,950	100.68 123,840,090	0.100000 2027/09/20	0.81
30	99 20年国債	日本	国債証券	98,000,000	120.70 118,286,980	120.60 118,194,860	2.100000 2027/12/20	0.77

(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	99.33%
合計	99.33%

(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。

#### 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29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	441,607,477	96.57
内 ユーロ	183,530,528	40.14
内 シンガポール	885,142	0.19
内 マレーシア	1,888,843	0.41
内 ノルウェー	957,977	0.21
内 スウェーデン	1,717,738	0.38
内 デンマーク	2,779,242	0.61
内 イギリス	30,930,493	6.76
内 ポーランド	2,545,143	0.56
内 カナダ	9,218,542	2.02
内 アメリカ	193,468,088	42.31
内 メキシコ	3,249,463	0.71
内 南アフリカ	2,022,358	0.44
内 オーストラリア	8,413,920	1.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,662,028	3.43
純資産総額	457,269,505	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)	5,731,850	1.25
内 日本	5,731,850	1.25

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

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

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

## (2) 投資資産（平成29年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	709,000	101.28 80,462,846	100.49 79,834,311	2.125000 2021/09/30	17.46

2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	548,000	99.22 60,927,353	98.67 60,592,261	1.125000 2019/12/31	13.25
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	295,000	108.50 35,866,301	110.75 36,610,449	3.375000 2044/05/15	8.01
4	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	117,000	123.70 19,222,354	125.84 19,554,920	5.000000 2025/03/01	4.28
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	92,000	144.76 17,688,395	144.50 17,655,761	6.000000 2029/01/31	3.86
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	126,000	100.19 14,145,830	99.91 14,106,158	2.250000 2024/11/15	3.08
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	87,000	118.62 13,706,374	120.81 13,959,879	2.750000 2027/10/25	3.05
8	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	48,000	173.11 12,491,438	168.52 12,160,133	4.250000 2055/12/07	2.66
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	71,000	110.07 10,379,344	111.19 10,484,672	1.750000 2024/11/25	2.29
10	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	74,000	102.25 10,049,854	101.82 10,007,201	0.250000 2019/10/11	2.19
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	51,000	140.25 9,500,041	143.19 9,698,905	6.500000 2027/11/01	2.12
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	41,000	169.81 9,246,724	166.80 9,082,719	6.250000 2030/01/04	1.99
13	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	62,000	109.75 9,037,407	109.22 8,993,579	1.500000 2023/02/15	1.97
14	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	53,000	114.70 9,138,861	111.46 8,880,644	3.750000 2021/09/07	1.94
15	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	52,000	121.43 8,386,740	118.76 8,201,846	5.500000 2021/04/30	1.79
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	54,000	109.76 7,872,275	110.13 7,898,811	1.750000 2023/05/25	1.73
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	38,000	132.27 6,675,508	137.41 6,935,032	3.250000 2045/05/25	1.52
18	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	44,000	115.31 6,738,359	113.63 6,640,361	3.250000 2021/07/15	1.45
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	48,000	102.89 6,559,161	102.50 6,534,570	1.000000 2019/05/25	1.43
20	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	65,000	108.20 6,125,896	104.98 5,943,612	3.500000 2020/06/01	1.30
21	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	38,000	109.49 5,525,971	108.02 5,451,935	4.250000 2019/09/01	1.19
22	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	30,000	127.01 5,060,818	133.62 5,323,901	4.750000 2044/09/01	1.16
23	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	25,000	136.60 5,133,769	133.31 5,010,123	4.250000 2032/06/07	1.10
24	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	25,500	131.72 5,049,374	127.29 4,879,591	5.000000 2025/03/07	1.07
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	27,000	131.20 4,704,684	131.49 4,715,275	2.500000 2044/07/04	1.03
26	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	43,000	118.04 4,307,800	121.91 4,449,214	4.500000 2033/04/21	0.97

27	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	30,000	111.89 4,458,073	111.18 4,429,744	4.000000 2020/09/01	0.97
28	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	28,000	120.69 4,488,112	118.92 4,422,291	4.000000 2022/03/28	0.97
29	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	20,000	153.64 4,081,118	157.47 4,182,904	4.250000 2041/03/28	0.91
30	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	25,000	114.36 3,797,170	112.10 3,722,166	4.500000 2020/04/18	0.81

(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	96.57%
合計	96.57%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2017年12月	買建	14,000	1,217,753	1,187,760	0.26%
		カナダ・ドル買/円売 2017年12月	買建	3,000	264,156	261,240	0.06%
		スイス・フラン買/円売 2017年12月	買建	2,000	228,151	227,680	0.05%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2017年12月	買建	2,000	35,595	35,680	0.01%
		ユーロ買/円売 2017年12月	買建	12,000	1,589,310	1,593,720	0.35%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2017年12月	買建	15,000	119,712	122,850	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2017年12月	買建	21,000	123,912	126,420	0.03%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2017年12月	買建	9,000	124,924	122,130	0.03%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2017年12月	買建	11,000	149,356	147,180	0.03%
		米ドル買/円売 2017年12月	買建	13,000	1,476,801	1,456,260	0.32%
		英ポンド買/円売 2017年 12月	買建	3,000	452,481	450,930	0.10%

(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29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	3,594,979,389	97.64
内 アメリカ	3,594,979,389	97.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	86,895,915	2.36
純資産総額	3,681,875,304	100.00

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

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

## (2) 投資資産（平成29年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	875,900	120.74 118,509,493	116.99 114,823,285	7.500000 2030/03/31	3.12
2	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	750,000	110.35 92,735,381	113.30 95,214,487	7.500000 2026/04/22	2.59
3	Colombia Government International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	101.00 67,902,300	104.75 70,423,425	5.000000 2045/06/15	1.91
4	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	522,000	117.95 68,990,865	120.02 70,202,742	6.050000 2040/01/11	1.91
5	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	450,000	109.25 55,086,581	108.83 54,878,336	6.875000 2021/04/22	1.49
6	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	450,000	103.08 51,977,193	107.55 54,229,398	6.625000 2028/07/06	1.47
7	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	460,000	99.08 51,072,390	102.75 52,960,432	4.750000 2044/03/08	1.44
8	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	400,000	108.12 48,460,728	108.93 48,822,874	4.875000 2023/09/16	1.33
9	Panama Government International Bond	アメリカ	国債証券	320,000	132.24 47,416,758	135.00 48,405,600	6.700000 2036/01/26	1.31
10	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	103.75 46,500,750	105.52 47,296,305	4.125000 2026/01/21	1.28
11	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	105.67 47,363,535	104.42 46,804,181	6.000000 2027/03/25	1.27
12	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	400,000	101.77 45,613,314	101.72 45,593,145	4.250000 2025/01/07	1.24
13	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	96.52 43,262,505	100.40 44,999,280	4.600000 2046/01/23	1.22
14	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	103.19 46,251,550	98.43 44,116,774	6.000000 2041/01/14	1.20



15	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	98.81 44,288,883	96.78 43,377,244	4.875000 2026/10/09	1.18
16	Brazilian Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	90.50 40,562,100	94.10 42,175,620	5.000000 2045/01/27	1.15
17	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	350,000	105.03 41,192,661	105.40 41,335,245	4.000000 2023/10/02	1.12
18	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	310,000	109.77 38,130,895	114.77 39,867,670	5.550000 2045/01/21	1.08
19	Hungary Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	115.12 38,699,829	114.97 38,650,190	5.750000 2023/11/22	1.05
20	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	470,000	66.61 35,083,975	73.35 38,628,677	2.500000 2038/12/31	1.05
21	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	320,000	105.95 37,989,432	106.55 38,204,568	4.875000 2021/01/22	1.04
22	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	89.56 40,142,584	85.12 38,153,025	4.875000 2043/04/16	1.04
23	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	106.25 35,715,937	112.30 37,749,645	7.625000 2046/04/22	1.03
24	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	109.17 36,699,176	109.75 36,892,462	4.125000 2027/08/25	1.00
25	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	108.80 36,573,120	109.40 36,774,810	6.875000 2027/01/26	1.00
26	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	108.25 36,388,237	108.35 36,421,852	7.125000 2036/07/06	0.99
27	South Africa Government International	アメリカ	国債証券	300,000	106.75 35,884,012	108.03 36,314,284	5.875000 2025/09/16	0.99
28	Romanian Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	106.45 35,786,080	107.32 36,077,634	4.375000 2023/08/22	0.98
29	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	105.50 35,463,825	105.25 35,379,787	5.625000 2022/01/26	0.96
30	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	260,000	116.09 33,822,539	113.60 33,097,127	7.375000 2025/02/05	0.90

(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	97.64%
合計	97.64%

(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。

[次へ](#)

## (参考情報) 運用実績

## スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）

2017年11月30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	12,887円
純資産総額	65百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	0.2%
3か月間	3.9%
6か月間	6.5%
1年間	13.3%
3年間	3.3%
5年間	-
設定来	28.9%



※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 14年5月	第2期 15年5月	第3期 16年5月	第4期 17年5月						
分配金	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

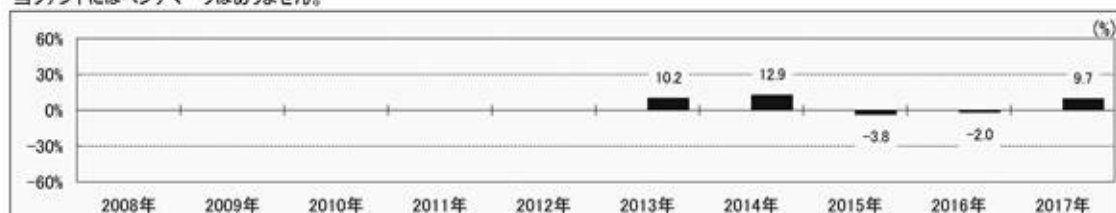
※比率は、純資産総額に対するものです。

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
国内株式MF	16.7%	外国債券	179	32.0%	米ドル	51.9%	TOPIX先物 2912月	日本	16.5%
先進国株式MF	16.7%	外国投資信託等	5	19.1%	日本円	34.3%	MINI MSCI EMG MKT 201712	アメリカ	10.2%
新興国債券MF	16.5%	国内株式・先物	2	16.7%	ユーロ	11.1%	ISHARES CORE S&P 500 ETF	アメリカ	9.1%
先進国債券MF	16.5%	国内債券	220	16.3%	英ポンド	1.1%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	6.1%
国内債券MF	16.4%	外国株式・先物	5	13.9%	豪ドル	0.3%	ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	ドイツ	2.4%
新興国株式MF	16.3%				カナダ・ドル	0.3%	STOXX EUROPE 600 IND 201712	ドイツ	2.0%
					メキシコ・ペソ	0.1%	S&P500 E-MINI FUTURE 201712	アメリカ	1.8%
					デンマーク・クローネ	0.1%	ISHARES MSCI PACIFIC EX JAPA	アメリカ	0.8%
					ポーランド・ズロチ	0.1%	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	0.6%
		コール・ローン、その他		32.6%	その他	0.4%	ミニTPX先物 2912月	日本	0.2%
合計	99.1%	合計	411	-	合計	100.0%	合計		49.7%

※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。

※2013年は設定日(6月10日)から年末、2017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29年5月9日から平成29年11月8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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,176,930
親投資信託受益証券		66,761,951
流動資産合計		67,938,881
資産合計		67,938,881
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		18,960
未払委託者報酬		494,017
その他未払費用		2,744
流動負債合計		515,721
負債合計		515,721
純資産の部		
元本等		
元本	1	51,845,575
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		15,577,585
（分配準備積立金）		3,556,104
元本等合計		67,423,160
純資産合計		67,423,160
負債純資産合計		67,938,881

[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29年5月9日 至 平成29年11月8日 金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	5,476,693
営業収益合計	5,476,693
営業費用	
支払利息	176
受託者報酬	18,960
委託者報酬	494,017
その他費用	2,744
営業費用合計	515,897
営業利益又は営業損失( )	4,960,796
経常利益又は経常損失( )	4,960,796
中間純利益又は中間純損失( )	4,960,796
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	592,891
期首剰余金又は期首欠損金( )	12,536,460
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,704,168
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,704,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,030,948
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,030,948
中間剰余金又は中間欠損金( )	15,577,585

[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29年5月9日 至 平成29年11月8日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成29年11月8日現在
1. 1期首元本額	59,325,769円
期中追加設定元本額	6,746,523円
期中一部解約元本額	14,226,717円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	51,845,575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29年5月9日 至 平成29年11月8日
	該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成29年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成29年11月8日現在
	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.3005円

(1万口当たり純資産額)

(13,005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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,866,329,587
派生商品評価勘定		272,082,040
未収入金		476,468
差入委託証拠金		101,323,500
流動資産合計		4,240,211,595
資産合計		4,240,211,595
負債の部		
流動負債		
前受金		268,326,500
未払解約金		5,326,800
流動負債合計		273,653,300
負債合計		273,653,300
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,271,575,776
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,694,982,519
元本等合計		3,966,558,295
純資産合計		3,966,558,295
負債純資産合計		4,240,211,595

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8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。 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。 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29年11月8日現在
1.	1 期首	平成29年5月9日
	期首元本額	1,522,200,485円
	期中追加設定元本額	4,938,251,054円
	期中一部解約元本額	4,188,875,763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）	1,688,626,630円
	国内株式ファンド（適格機関 投資家専用）	307,457,410円
	スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジあり）	11,965,406円
	スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし）	6,504,386円
	スマート・アロケーション・ Dガード	1,417,205円
	りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	36,985,084円
	堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	32,545,950円
	DCダイワ8資産アロケーシ ョン・ファンド	33,611円
	DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	3,650,936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）	2,856,292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）	72,388,676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）	97,427,843円
	DCスマート・アロケーシ ョン・Dガード	123,049円
	計	2,271,575,776円
2.	期末日における受益権の総数	2,271,575,776口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月8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)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。  (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

## 株式関連

種 類	平成29年11月8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	3,691,026,900	-	3,963,228,500	272,201,600
合計	3,691,026,900	-	3,963,228,500	272,201,600

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.7462円
(1万口当たり純資産額)	(17,462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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		42,816,013
コール・ローン		400,047,074
投資信託受益証券		2,806,278,586
投資証券		327,988,191
派生商品評価勘定		6,242,149
差入委託証拠金		163,549,299
流動資産合計		3,746,921,312
資産合計		3,746,921,312
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,273,365
未払解約金		2,762,000
流動負債合計		4,035,365
負債合計		4,035,365
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,133,545,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,609,340,428
元本等合計		3,742,885,947
純資産合計		3,742,885,947
負債純資産合計		3,746,921,312

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8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29年11月8日現在
1. 1 期首	平成29年5月9日
期首元本額	1,333,937,289円
期中追加設定元本額	4,854,335,593円
期中一部解約元本額	4,054,727,363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）	1,652,233,140円
先進国株式ファンド（適格機関投資家専用）	299,161,983円

スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）	6,324,381円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	36,219,381円
堅実バランスファンド - ハジメの一步 -	31,334,489円
DCダイワ8資産アロケーション・ファンド	31,614円
DCダイナミック・アロケーション・ファンド	3,578,783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）	95,201,373円
計	2,133,545,519円
2. 期末日における受益権の総数	2,133,545,519口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成29年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種類	平成29年11月8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	601,248,849	-	607,068,187	5,819,338
合計	601,248,849	-	607,068,187	5,819,338

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

## 4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	平成29年11月8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	396,221,747	-	395,371,193	850,554
アメリカ・ドル	206,586,963	-	206,722,278	135,315
ユーロ	189,634,784	-	188,648,915	985,869
合計	396,221,747	-	395,371,193	850,554

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.7543円
(1万口当たり純資産額)	(17,543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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		3,680,307,514
コール・ローン		112,124,051
株式		1
投資証券		1,551,725,192
派生商品評価勘定		78,092,579
未収入金		905,225,617
未収配当金		990,927
差入委託証拠金		901,984,846
流動資産合計		7,230,450,727
資産合計		7,230,450,727
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		57,120
未払解約金		6,382,400
流動負債合計		6,439,520
負債合計		6,439,520
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,020,214,055
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,203,797,152
元本等合計		7,224,011,207
純資産合計		7,224,011,207
負債純資産合計		7,230,450,727

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</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>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式、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29年11月8日現在
1.	1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額	平成29年5月9日 5,471,171,975円 403,314,623円

期中一部解約元本額	854,272,543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）	4,445,066,483円
新興国株式ファンド（適格機 関投資家専用）	367,090,286円
スマート・ミックス・Dガー ド（為替ヘッジなし）	7,808,432円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	32,692,407円
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	38,270,325円
DCダイワ8資産アロケーシ ョン・ファンド	38,404円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	3,217,990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）	116,129,728円
計	5,020,214,055円
2. 期末日における受益権の総数	5,020,214,055口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	平成29年11月8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	2,908,009,339	-	2,985,499,238	77,489,899
合計	2,908,009,339	-	2,985,499,238	77,489,899

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	平成29年11月8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				
売 建	2,707,192,880	-	2,707,250,000	57,120
アメリカ・ドル	2,707,192,880	-	2,707,250,000	57,120
買 建	107,459,820	-	108,062,500	602,680
アメリカ・ドル	107,459,820	-	108,062,500	602,680
合計	2,814,652,700	-	2,815,312,500	545,560

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4390円 (14,390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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		67,941,159
国債証券		12,006,166,160
未収利息		19,048,740
前払費用		10,419,535
流動資産合計		12,103,575,594
資産合計		12,103,575,594
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,843,000
流動負債合計		1,843,000
負債合計		1,843,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,958,131,991
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,143,600,603
元本等合計		12,101,732,594
純資産合計		12,101,732,594
負債純資産合計		12,103,575,594

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8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29年11月8日現在
1. 1 期首	平成29年5月9日
期首元本額	7,554,013,661円
期中追加設定元本額	27,613,701,793円
期中一部解約元本額	24,209,583,463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）	9,651,531,301円
スマート・ミックス・Dガー ド(為替ヘッジあり)	17,152,804円
スマート・ミックス・Dガー ド(為替ヘッジなし)	10,022,127円
スマート・アロケーション・ Dガード	13,376,671円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	299,125,755円
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	636,498,681円
DCダイワ8資産アロケーショ ン・ファンド	306,560円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	29,710,651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）	26,705,854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）	110,919,119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）	151,744,784円
DCスマート・アロケーショ ン・Dガード	1,137,684円
計	10,958,131,991円
2. 期末日における受益権の総数	10,958,131,991口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年11月8日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

平成29年11月8日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1044円 (11,044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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		3,712,133
コール・ローン		6,923,189
国債証券		445,786,781
派生商品評価勘定		4,986
未収利息		3,800,782
前払費用		481,151
流動資産合計		460,709,022
資産合計		460,709,022
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		12,949
未払金		4,624
未払解約金		1,023,000
流動負債合計		1,040,573
負債合計		1,040,573
純資産の部		
元本等		
元本	1	379,152,577
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		80,515,872
元本等合計		459,668,449
純資産合計		459,668,449
負債純資産合計		460,709,022

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8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	為替予約取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年11月8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29年5月9日  1,245,775,411円  113,383,857円  980,006,691円</p>
<p>期末元本額の内訳  ファンド名</p> <p>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)</p> <p>スマート・ミックス・Dガー  ド(為替ヘッジなし)</p> <p>スマート・アロケーション・  Dガード</p> <p>堅実バランスファンド - ハジ  メの一步 -</p> <p>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)</p> <p>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)</p> <p>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</p> <p>9,141,973円</p> <p>48,745,195円</p> <p>67,538,065円</p> <p>96,895,370円</p> <p>137,879,375円</p> <p>4,102,599円</p> <p>379,152,577円</p>
<p>2. 期末日における受益権の総数</p>	<p>379,152,577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29年11月8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  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>



## (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成29年11月8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	5,901,863	-	5,893,900	7,963
アメリカ・ドル	1,476,801	-	1,477,190	389
イギリス・ポンド	452,481	-	449,220	3,261
オーストラリア ・ドル	1,217,753	-	1,216,880	873
カナダ・ドル	264,156	-	267,150	2,994
スイス・フラン	228,151	-	227,900	251
スウェーデン・ クローナ	149,356	-	149,160	196
デンマーク・ク ローネ	35,595	-	35,440	155
ノルウェー・ク ローネ	124,924	-	125,280	356
メキシコ・ペソ	123,912	-	123,900	12
ユーロ	1,589,310	-	1,583,280	6,030
南アフリカ・ラ ンド	239,424	-	238,500	924
合計	5,901,863	-	5,893,900	7,963

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （1口当たり情報）

	平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2124円 (12,124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29年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		36,196,179
コール・ローン		20,847,681
国債証券		3,607,930,021
未収利息		39,899,610
前払費用		13,375,360
流動資産合計		3,718,248,851
資産合計		3,718,248,851
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,090,200
流動負債合計		1,090,200
負債合計		1,090,200
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,703,693,677
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,013,464,974
元本等合計		3,717,158,651
純資産合計		3,717,158,651
負債純資産合計		3,718,248,851

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年5月9日 至 平成29年11月8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29年11月8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） りそな 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ダイワ8資産アロケーシ ョン・ファンド 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29年5月9日 3,665,470,591円 924,449,425円 1,886,226,339円  29,296,871円 455,923,547円 1,989,586,352円 7,943,435円 38,486,780円 58,756,351円 38,834円 3,812,143円 119,849,364円 2,703,693,677円
2. 期末日における受益権の総数	2,703,693,677口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年11月8日 現在

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成29年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.3748円
(1万口当たり純資産額)	(13,748円)

## 2 【ファンドの現況】

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

<訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成29年11月30日

資産総額	65,169,666円
負債総額	58,306円
純資産総額（ - ）	65,111,360円
発行済数量	50,524,048口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2887円

(参考) 国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	5,043,383,575円
負債総額	87,245,318円
純資産総額（ - ）	4,956,138,257円
発行済数量	2,876,265,532口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7231円

(参考) 先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	5,457,715,383円
負債総額	582,972,077円
純資産総額（ - ）	4,874,743,306円
発行済数量	2,790,282,016口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7470円

(参考) 新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	803,897,578円
負債総額	2,202,000円

純資産総額( - )	801,695,578円
発行済数量	564,270,690口
1単位当たり純資産額( / )	1.4208円

## (参考) 国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	15,302,872,355円
負債総額	1,590,000円
純資産総額( - )	15,301,282,355円
発行済数量	13,875,562,712口
1単位当たり純資産額( / )	1.1028円

## (参考) 先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	457,329,947円
負債総額	60,442円
純資産総額( - )	457,269,505円
発行済数量	380,090,361口
1単位当たり純資産額( / )	1.2031円

## (参考) 新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年11月30日

資産総額	3,681,875,304円
負債総額	0円
純資産総額( - )	3,681,875,304円
発行済数量	2,705,696,612口
1単位当たり純資産額( / )	1.3608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

2017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。

2017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	79	213,001
追加型株式投資信託	708	15,077,480
株式投資信託 合計	787	15,290,481
単位型公社債投資信託	24	129,706
追加型公社債投資信託	14	1,636,282
公社債投資信託 合計	38	1,765,988
総合計	825	17,056,469

## 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58期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第59期事業年度に係る中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	229
建物	18	15
器具備品	224	214

無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	4,946
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13

その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531
賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305

特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 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
-------	-----	-----	--------

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3．引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）



## （損益計算書）

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

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

## （追加情報）

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

## （貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額

(1) 現金・預金	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 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。

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

(1) 其他有価証券 非上場株式	1,021	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,049	1,050

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成28年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成28年3月31日)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

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

2. 其他有価証券

## 前事業年度（平成28年3月31日）

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

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

## 当事業年度（平成29年3月31日）

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

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

## 3. 売却したその他有価証券

## 前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,209	2,318

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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



	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1 . 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	--------------------	-------	-------------------------------	---------------	-------	-----------------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 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29年9月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,206
有価証券	98
未収委託者報酬	11,259
繰延税金資産	391
その他	278
流動資産合計	34,233
固定資産	
有形固定資産	1 231
無形固定資産	
ソフトウェア	2,066
その他	446
無形固定資産合計	2,512

投資その他の資産	
投資有価証券	6,874
関係会社株式	5,129
その他	1,262
投資その他の資産合計	13,266
固定資産合計	16,010
資産合計	50,244

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(平成29年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,070
未払費用		3,973
未払法人税等		916
賞与引当金		692
その他	2	606
流動負債合計		13,260

## 固定負債

退職給付引当金		2,324
役員退職慰労引当金		134
繰延税金負債		21
その他		6
固定負債合計		2,487

## 負債合計

15,747

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

## 利益剰余金

利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		7,116

利益剰余金合計	7,490
株主資本合計	34,160
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	336
評価・換算差額等合計	336
純資産合計	34,496
負債・純資産合計	50,244

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成29年4月1日	
	至 平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		40,996
その他営業収益		364
営業収益合計		41,360
営業費用		
支払手数料		20,216
その他営業費用		6,325
営業費用合計		26,542
一般管理費	1	5,665
営業利益		9,152
営業外収益	2	222
営業外費用		9
経常利益		9,365
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		9,365
法人税、住民税及び事業税		2,879
法人税等調整額		69
中間純利益		6,416

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
中間純利益	-	-	-	6,416	6,416	6,416
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	-	-	-	5,115	5,115	5,115
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,116	7,490	34,160

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
中間純利益	-	-	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	72	72	72
当中間期変動額合計	72	72	5,043
当中間期末残高	336	336	34,496

## 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) 其他有価証券

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29年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

## 2 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。

## 3 保証債務

当中間会計期間（平成29年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,744百万円に対して保証を行っております。

(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29年4月1日 至 平成29年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	471百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
受取配当金	49百万円
投資有価証券売却益	134百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成29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	22,206	22,206	-
(2) 未収委託者報酬	11,259	11,259	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,002	6,002	-
資産合計	39,467	39,467	-
(1) 未払金(*)	7,002	7,002	-
(2) 未払費用(*)	3,424	3,424	-
負債合計	10,427	10,427	-

(\*) 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、時価は帳簿価額と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	970
子会社株式	5,129
差入保証金	1,044

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29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	124	55	69
(2) その他			
証券投資信託	4,458	3,979	479
小計	4,582	4,034	548
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	1,419	1,482	63
小計	1,419	1,482	63
合計	6,002	5,517	485

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

## 〔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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29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29年4月1日 至 平成29年9月30日)
--

1株当たり純資産額	13,224.69円
1株当たり中間純利益金額	2,459.79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29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,416
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,416
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。

### 第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

<略>

## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月8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29年5月9日から平成29年11月8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29年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年5月9日から平成29年11月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係



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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[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29年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29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29年4月1日から平成29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。