

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年12月20日提出
【計算期間】	第7計算期間中 (自 2019年3月28日 至 2019年9月27日)
【ファンド名】	US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

1 【ファンドの運用状況】

【US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)】

(1) 【投資状況】(2019年9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	16,319,318	98.87
内 ケイマン諸島	16,319,318	98.87
親投資信託受益証券	1,705	0.01
内 日本	1,705	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	184,349	1.12
純資産総額	16,505,372	100.00

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

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

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2014年3月27日)	93,418,279	93,418,279	1.0276	1.0276
第2計算期間末 (2015年3月27日)	144,282,580	144,282,580	1.0435	1.0435
第3計算期間末 (2016年3月28日)	42,065,753	42,065,753	0.9865	0.9865
第4計算期間末 (2017年3月27日)	40,756,634	40,756,634	1.0122	1.0122
第5計算期間末 (2018年3月27日)	20,483,759	20,483,759	0.9943	0.9943
2018年9月末日	19,577,764	-	0.9738	-
10月末日	18,295,041	-	0.9559	-
11月末日	18,102,706	-	0.9458	-
12月末日	26,749,149	-	0.9347	-
2019年1月末日	27,362,241	-	0.9561	-
2月末日	27,521,550	-	0.9617	-
第6計算期間末 (2019年3月27日)	27,642,578	27,642,578	0.9659	0.9659
3月末日	27,626,278	-	0.9654	-

4月末日	17,632,378	-	0.9688	-
5月末日	17,510,020	-	0.9621	-
6月末日	17,716,991	-	0.9735	-
7月末日	17,695,443	-	0.9723	-
8月末日	17,706,053	-	0.9729	-
9月末日	16,505,372	-	0.9681	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2019年3月28日～ 2019年9月27日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	1.5
第3計算期間	5.5
第4計算期間	2.6
第5計算期間	1.8
第6計算期間	2.9
2019年3月28日～ 2019年9月27日	0.3

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年9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)	72,119,936,130	100.00
純資産総額	72,119,936,130	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。

(参考情報) 運用実績

● US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)

2019年9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	9,681円
純資産総額	16百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	-0.6%
6カ月間	0.3%
1年間	-0.6%
3年間	-5.7%
5年間	-6.6%
設定来	-3.2%

※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実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	14年3月	15年3月	16年3月	17年3月	18年3月	19年3月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

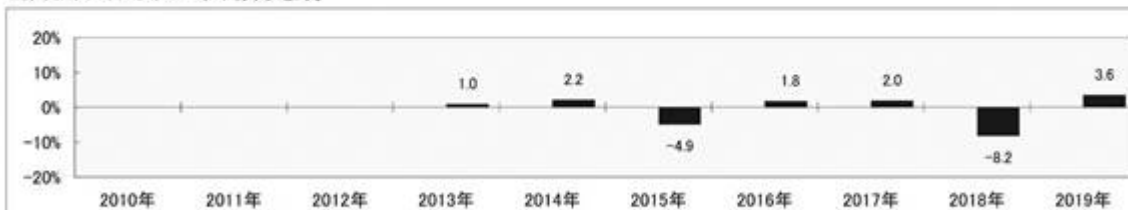
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズLLC/大和証券投資信託委託	ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(円ヘッジ/N1クラス)	98.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.0%
合計		98.9%

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(7月12日)から年末、2019年は9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。

【US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)】

(1) 【投資状況】（2019年9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	28,443,191	99.01
内 ケイマン諸島	28,443,191	99.01
親投資信託受益証券	1,353	0.00
内 日本	1,353	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	281,869	0.98
純資産総額	28,726,413	100.00

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

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

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2014年3月27日)	242,850,387	242,850,387	1.0585	1.0585
第2計算期間末 (2015年3月27日)	355,459,329	355,459,329	1.2512	1.2512
第3計算期間末 (2016年3月28日)	190,629,572	190,629,572	1.1291	1.1291
第4計算期間末 (2017年3月27日)	94,008,464	94,008,464	1.1612	1.1612
第5計算期間末 (2018年3月27日)	74,746,106	74,746,106	1.1025	1.1025
2018年9月末日	66,659,226	-	1.1794	-
10月末日	59,035,144	-	1.1553	-
11月末日	57,801,497	-	1.1511	-
12月末日	52,546,765	-	1.1163	-
2019年1月末日	53,437,029	-	1.1334	-
2月末日	35,437,311	-	1.1583	-
第6計算期間末 (2019年3月27日)	34,669,078	34,669,078	1.1617	1.1617
3月末日	34,698,176	-	1.1619	-
4月末日	34,106,039	-	1.1783	-
5月末日	29,833,484	-	1.1550	-

6月末日	29,768,350	-	1.1501	-
7月末日	28,720,006	-	1.1606	-
8月末日	28,293,500	-	1.1408	-
9月末日	28,726,413	-	1.1558	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2019年3月28日～ 2019年9月27日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	5.9
第2計算期間	18.2
第3計算期間	9.8
第4計算期間	2.8
第5計算期間	5.1
第6計算期間	5.4
2019年3月28日～ 2019年9月27日	0.9

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネー・マザーファンド

前記「US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

● US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)

2019年9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	11,558円
純資産総額	28百万円



※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実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	14年3月	15年3月	16年3月	17年3月	18年3月	19年3月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円					

※分配金は、収益配分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。

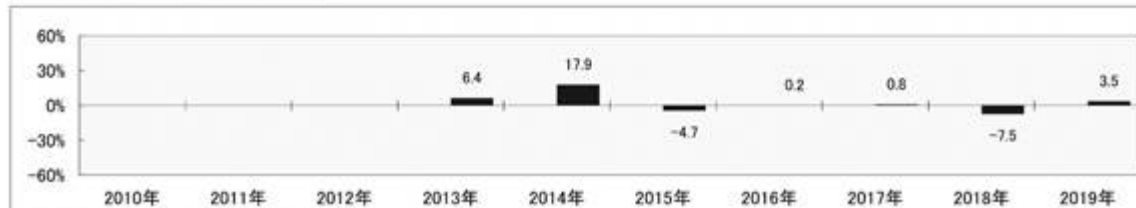
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズLLC	ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジ/N1クラス)	99.0%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.0%
合計		99.0%

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(7月12日)から年末、2019年は9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。

2 【設定及び解約の実績】

US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	90,911,942	1,000,000
第2計算期間	563,865,525	516,510,598
第3計算期間	1,237,995	96,862,669
第4計算期間	661,500	3,036,388
第5計算期間	1,169,067	20,834,570
第6計算期間	10,417,725	2,402,328
2019年3月28日～ 2019年9月27日	0	11,567,631

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	229,424,392	1,000,000
第2計算期間	254,324,770	199,655,991
第3計算期間	77,541,992	192,807,584
第4計算期間	1,444,612	89,310,813
第5計算期間	26,936,154	40,100,159
第6計算期間	1,810,740	39,765,057
2019年3月28日～ 2019年9月27日	1,165,474	6,173,701

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

3 【ファンドの経理状況】

【US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)】

(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(2019年3月28日から2019年9月27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。

US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	425,314	297,944
投資信託受益証券	27,358,926	16,329,111
親投資信託受益証券	1,705	1,705
流動資産合計	27,785,945	16,628,760
資産合計	27,785,945	16,628,760
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,746	2,873
未払委託者報酬	138,716	108,471
その他未払費用	905	592
流動負債合計	143,367	111,936
負債合計	143,367	111,936
純資産の部		
元本等		
元本	1 28,617,201	1 17,049,570
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 974,623	2 532,746
(分配準備積立金)	195,830	116,673
元本等合計	27,642,578	16,516,824
純資産合計	27,642,578	16,516,824
負債純資産合計	27,785,945	16,628,760

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2018年3月28日 至 2018年9月27日	当中間計算期間 自 2019年3月28日 至 2019年9月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	300,892	170,185
営業収益合計	300,892	170,185
営業費用		
受託者報酬	3,257	2,873
委託者報酬	120,419	108,471
その他費用	736	592
営業費用合計	124,412	111,936
営業利益又は営業損失()	425,304	58,249
経常利益又は経常損失()	425,304	58,249
中間純利益又は中間純損失()	425,304	58,249
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	7,834	10,330
期首剰余金又は期首欠損金()	118,045	974,623
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,845	393,958
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,845	393,958
中間剰余金又は中間欠損金()	532,670	532,746

(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 2019年3月28日	至 2019年9月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
1. 1 期首元本額	20,601,804円	28,617,201円
期中追加設定元本額	10,417,725円	- 円
期中一部解約元本額	2,402,328円	11,567,631円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	28,617,201口	17,049,570口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は974,623円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は532,746円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2018年3月28日 至 2018年9月27日	自 2019年3月28日 至 2019年9月27日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
1口当たり純資産額	0.9659円	0.9688円
(1万口当たり純資産額)	(9,659円)	(9,688円)

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(円ヘッジ/N1クラス)」の受益証券(円建)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「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネー・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、同ファンドの状況及び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。

「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(円ヘッジ/N1クラス)」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(米ドル建て)

貸借対照表
2018年2月28日

資産		
投資資産の評価額(簿価 \$27,192,723)	\$	27,285,425
現金		568
外国為替先渡契約による評価益		394,652
未収:		
売却済みの投資		148,213
売却済みの投資(繰延受渡)		563,896
利息		75,761
スワップ契約に係る未収変動証拠金		53,957
資産合計		28,522,472
負債		
外国為替先渡契約による評価損		4,801
先物取引に係る未払変動証拠金		18,974
未払:		
購入済みの投資		150,000
購入済みの投資(繰延受渡)		5,827,473
償還済み受益証券		46,858
専門家報酬		59,304
保管会社報酬		34,936
運用会社報酬		19,985
会計および管理会社報酬		14,703
名義書換代理人報酬		800
為替取引執行会社報酬		566
為替運用会社報酬		141
その他負債		928
負債合計		6,179,469
純資産	\$	22,343,003

純資産

通貨セレクトクラス	\$	1,164,147
通貨分散/N1クラス		131,285
円ヘッジクラス		10,391,954
円ヘッジ/N1クラス		5,659,544
ノンヘッジクラス		2,571,259
ノンヘッジ/N1クラス		2,424,814
		22,343,003

発行済み受益証券口数

通貨セレクトクラス	1,868,808
通貨分散/N1クラス	156,646
円ヘッジクラス	13,015,970
円ヘッジ/N1クラス	5,662,947
ノンヘッジクラス	2,266,340
ノンヘッジ/N1クラス	2,145,033

受益証券1口当り純資産額

通貨セレクトクラス	\$	0.623
通貨分散/N1クラス	\$	0.838
円ヘッジクラス	\$	0.798
円ヘッジ/N1クラス	\$	0.999
ノンヘッジクラス	\$	1.135
ノンヘッジ/N1クラス	\$	1.130

損益計算書

2018年2月28日に終了した年度

投資収益

受取利息(源泉徴収税 \$3,395 控除後)	\$	559,398
配当収益(源泉徴収税 \$105,021 控除後)		245,048
投資収益合計		804,446

費用

運用会社報酬	132,844
保管会社報酬	109,576
専門家報酬	59,564
会計および管理会社報酬	45,001
受託会社報酬	29,544
名義書換代理人報酬	9,434
登録料	2,128
為替運用会社報酬	2,089
為替取引執行会社報酬	1,826
費用合計	392,006

投資純利益

412,440

実現益(損)および評価益(損):**実現益(損):**

証券投資	(29,487)
先物取引	36,265
スワップ契約	46,050
外国為替取引および外国為替先渡契約	166,611
純実現益	219,439

評価益(損)の純変動:

証券投資	(18,684)
スワップ契約	719
先物取引	31,325
外国為替換算および外国為替先渡契約	351,878

評価益(損)の純変動	365,238
純実現・純評価益	584,677
運用による純資産の純増	\$ 997,117

(米ドル建て)

投資明細表
2018年2月28日

元本	有価証券の明細	評価額
	債券(78.4%)	
	オーストラリア(0.5%)	
	社債(0.5%)	
	Westpac Banking Corp.(a),(b),(c)	
USD	115,000 5.00% due 2049/12/31	\$ 109,947
	社債合計	109,947
	オーストラリア合計(簿価 \$115,000)	109,947
	ブラジル(0.3%)	
	社債(0.3%)	
	Vale Overseas, Ltd.	
USD	55,000 6.25% due 2026/8/10	62,024
	社債合計	62,024
	ブラジル合計(簿価 \$62,285)	62,024
	フランス(0.4%)	
	社債(0.4%)	
	BNP Paribas S.A.	
USD	85,000 2.38% due 2020/5/21	83,985
	社債合計	83,985
	フランス合計(簿価 \$84,174)	83,985
	メキシコ(0.8%)	
	社債(0.8%)	
	Grupo Bimbo SAB de CV(a)	
USD	100,000 4.70% due 2047/11/10	95,750
	Petroleos Mexicanos(d)	
USD	80,000 6.50% due 2027/3/13	85,510
	社債合計	181,260
	メキシコ合計(簿価 \$183,958)	181,260
	スペイン(1.0%)	
	社債(1.0%)	
	Banco Santander S.A.	
USD	75,000 3.80% due 2028/2/23	72,076
	Telefonica Emisiones SAU	
USD	150,000 4.90% due 2048/3/6	150,593
	社債合計	222,669
	スペイン合計(簿価 \$225,366)	222,669
	英国(0.5%)	
	社債(0.5%)	
	HSBC Holdings PLC(a),(b),(c)	
USD	120,000 6.00% due 2049/12/31	122,580
	社債合計	122,580
	英国合計(簿価 \$120,000)	122,580
	米国(74.9%)	
	資産担保証券(19.9%)	
	Accredited Mortgage Loan Trust Series 2006-1 Class A4(a),(b)	
USD	228,680 1.90% due 2036/4/25	223,260
	Ally Auto Receivables Trust Series 2017-3 Class A2(a)	
USD	49,324 1.53% due 2020/3/16	49,187

		Capital One Multi-Asset Execution Trust Series 2014-A4 Class A4 (b)	
USD	240,000	1.95% due 2022/6/15	240,640
		Capital One Multi-Asset Execution Trust Series 2015-A1 Class A1	
USD	60,000	1.39% due 2021/1/15	59,993
		Capital One Multi-Asset Execution Trust Series 2016-A1 Class A1 (b)	
USD	40,000	2.04% due 2022/2/15	40,140
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2005-NC5 Class M1(a),(b)	
USD	280,000	2.10% due 2035/10/25	279,357
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 Class A4(a),(b)	
USD	415,000	1.93% due 2036/1/25	409,852
		Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-RFC1 Class A4(a),(b)	
USD	415,000	1.86% due 2036/5/25	409,148
		Chase Issuance Trust Series 2016-A2 Class A	
USD	200,000	1.37% due 2021/6/15	196,985
		COMM Mortgage Trust Series 2013-LC6 Class XB(b),(d)	
USD	4,000,000	0.37% due 2046/1/10	71,840
		COMM Mortgage Trust Series 2014-CR17 Class XA(b)	
USD	1,485,118	1.12% due 2047/5/10	66,298
		COMM Mortgage Trust Series 2014-UBS3 Class XA(b)	
USD	1,245,953	1.30% due 2047/6/10	63,228
		CWABS Asset-Backed Certificates Trust Series 2005-AB1 Class M1(a),(b)	
USD	106,417	2.25% due 2035/8/25	106,133
		Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Series 2017-DNA2 Class M2(a),(b)	
USD	250,000	5.07% due 2029/10/25	274,103
		Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2017-C03 Class 1M2(a),(b)	
USD	110,000	4.62% due 2029/10/25	117,485
		Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2017-C05 Class 1M2(a),(b)	
USD	75,000	3.82% due 2030/1/25	76,341
		GS Mortgage Securities Trust Series 2014-GC18 Class XA(b)	
USD	1,452,559	1.11% due 2047/1/10	64,823
		GSAA Home Equity Trust Series 2005-5 Class B1(a),(b)	
USD	90,000	3.35% due 2035/2/25	84,941
		Home Equity Asset Trust Series 2005-1 Class M5(a),(b)	
USD	65,000	2.72% due 2035/5/25	63,195
		HSI Asset Securitization Corp. Trust Series 2006-OPT1 Class M1 (a),(b)	
USD	50,000	1.98% due 2035/12/25	49,484
		JP Morgan Mortgage Acquisition Trust Series 2007-CH1 Class MV2 (a),(b)	
USD	115,000	1.90% due 2036/11/25	113,861
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2014-C16 Class XA(b)	
USD	1,529,030	1.16% due 2047/6/15	69,248
		Navient Student Loan Trust Series 2016-6 Class A1(a),(b),(d)	
USD	40,852	2.10% due 2066/3/25	40,956
		Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-WCH1 Class M4(a),(b)	
USD	303,000	2.87% due 2036/1/25	304,598
		RAAC Trust Series 2006-SP2 Class M1(a),(b)	
USD	200,000	1.96% due 2036/2/25	198,621
		RAMP Trust Series 2005-RZ2 Class M4(a),(b)	
USD	230,000	2.18% due 2035/5/25	229,772
		Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2005-WF4 Class M4(a),(b)	
USD	350,000	2.20% due 2035/11/25	351,977

		Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series	
		2006-AM1 Class A4(a),(b)	
USD	100,033	1.78% due 2036/4/25	99,662
		Toyota Auto Receivables Owner Trust Series 2017-B Class A2A(a)	
USD	92,516	1.46% due 2020/1/15	92,198
		資産担保証券合計	4,447,326
		社債 (15.7%)	
		Abbott Laboratories(a)	
USD	60,000	4.90% due 2046/11/30	64,523
		AbbVie, Inc.(a)	
USD	70,000	4.70% due 2045/5/14	72,227
		Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.(a)	
USD	45,000	4.70% due 2036/2/1	47,289
		Apple, Inc.(a)	
USD	70,000	4.65% due 2046/2/23	76,353
		AT&T, Inc.(a)	
USD	75,000	4.75% due 2046/5/15	71,059
USD	110,000	5.45% due 2047/3/1	114,596
		Bank of America Corp.	
USD	75,000	3.95% due 2025/4/21	74,881
		BAT Capital Corp.(a),(d)	
USD	105,000	4.54% due 2047/8/15	102,125
		Broadcom Corp. / Broadcom Cayman Finance, Ltd.(a)	
USD	20,000	3.50% due 2028/1/15	18,464
USD	125,000	3.88% due 2027/1/15	119,852
		Charter Communications Operating LLC / Charter Communications	
		Operating Capital(a)	
USD	165,000	4.91% due 2025/7/23	169,620
USD	30,000	5.38% due 2047/5/1	29,695
USD	65,000	6.48% due 2045/10/23	73,223
		Dell International LLC / EMC Corp.(a),(d)	
USD	145,000	5.45% due 2023/6/15	152,756
USD	60,000	6.02% due 2026/6/15	64,059
		Discovery Communications LLC(a)	
USD	60,000	5.00% due 2037/9/20	59,901
USD	50,000	5.20% due 2047/9/20	49,703
		Energy Transfer LP(a)	
USD	45,000	6.50% due 2042/2/1	49,794
		Energy Transfer Partners LP(a),(b),(c)	
USD	105,000	6.63% due 2049/12/31	101,062
		EPR Properties(a)	
USD	60,000	5.75% due 2022/8/15	64,145
		Ford Motor Credit Co. LLC	
USD	90,000	3.20% due 2021/1/15	89,408
		General Electric Co.(a),(b),(c)	
USD	295,000	5.00% due 2049/12/31	291,312
		Goldman Sachs Group, Inc.	
USD	35,000	2.60% due 2020/4/23(a)	34,727
USD	75,000	3.69% due 2028/6/5(a),(b)	72,975
USD	135,000	3.81% due 2029/4/23(a),(b)	131,808
USD	65,000	4.02% due 2038/10/31(a),(b)	62,811
USD	60,000	5.15% due 2045/5/22	64,724
		Hess Corp.(a)	
USD	55,000	4.30% due 2027/4/1	53,839
		Hewlett Packard Enterprise Co.(a)	
USD	70,000	3.60% due 2020/10/15	70,804
USD	95,000	4.90% due 2025/10/15	98,475
		JPMorgan Chase & Co.(a),(b)	
USD	55,000	3.88% due 2038/7/24	53,101
USD	55,000	3.90% due 2049/1/23	51,761
		Kinder Morgan, Inc.(a)	
USD	85,000	5.00% due 2021/2/15(d)	88,684

USD	90,000	5.55% due 2045/6/1 Kroger Co.(a)	94,759
USD	15,000	4.45% due 2047/2/1 Microsoft Corp.(a)	14,113
USD	55,000	4.50% due 2057/2/6 Morgan Stanley(a),(b)	60,382
USD	110,000	3.77% due 2029/1/24	107,644
USD	60,000	5.45% due 2049/12/31(c) MPLX LP(a)	61,350
USD	65,000	4.13% due 2027/3/1	64,502
USD	110,000	4.70% due 2048/4/15 Noble Energy, Inc.(a)	106,587
USD	75,000	5.25% due 2043/11/15 Synchrony Financial(a)	79,402
USD	35,000	2.70% due 2020/2/3 Verizon Communications, Inc.	34,757
USD	50,000	4.13% due 2046/8/15	44,549
USD	74,000	4.67% due 2055/3/15 Wells Fargo & Co.	69,112
USD	35,000	2.55% due 2020/12/7	34,572
		社債合計	3,511,485
		国債・機関債 (39.3%)	
		Federal Home Loan Mortgage Corp., TBA(e)	
USD	265,000	3.00% due 2033/3/1	263,758
USD	185,000	3.00% due 2048/3/1	179,171
USD	80,000	3.50% due 2033/3/1	81,368
USD	845,000	3.50% due 2048/3/1	843,933
USD	1,100,000	4.00% due 2048/3/1	1,126,598
USD	100,000	4.50% due 2043/3/15 Federal National Mortgage Association	104,710
USD	230,000	3.00% due 2033/3/1, TBA(e)	228,967
USD	745,000	3.50% due 2048/3/1, TBA(e)	743,595
USD	1,340,000	4.00% due 2048/3/1, TBA(e)	1,372,322
USD	280,000	4.50% due 2048/3/1, TBA(e)	293,110
USD	20,000	5.63% due 2037/7/15 U.S. Treasury Bonds	26,602
USD	170,000	2.25% due 2046/8/15 U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds	141,777
USD	195,592	2.38% due 2027/1/15	223,203
USD	740,608	2.50% due 2029/1/15	874,135
USD	104,165	3.38% due 2032/4/15	139,501
USD	251,493	3.63% due 2028/4/15	321,426
USD	659,824	3.88% due 2029/4/15 U.S. Treasury Inflation Indexed Notes	875,323
USD	395,515	0.25% due 2025/1/15 U.S. Treasury Notes	384,891
USD	100,000	1.13% due 2019/2/28	99,047
USD	385,000	1.50% due 2023/2/28	364,126
USD	15,000	1.63% due 2026/2/15	13,691
USD	80,000	2.13% due 2021/12/31	78,753
USD	5,000	2.25% due 2027/2/15	4,750
		国債・機関債合計	8,784,757
		米国合計 (簿価 \$16,732,169)	16,743,568
		債券合計 (簿価 \$17,522,952)	17,526,033
口数		上場投資信託(ETF) (34.5%)	
		米国 (34.5%)	
	19,420	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	1,673,616
	18,900	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	2,127,006
	50,510	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond ETF	1,828,967
	67,851	SPDR Bloomberg Barclays Short Term High Yield Bond ETF	1,866,581
	11,000	VanEck Vectors JP Morgan EM Local Currency Bond ETF	214,060

		米国合計	7,710,230
		上場投資信託(ETF)合計(簿価 \$7,620,609)	7,710,230
元本		短期投資(9.2%)	
		米国(6.7%)	
		国債・機関債(6.7%)	
		U.S. Treasury Bill ⁽¹⁾	
1,500,000		zero coupon, due 2018/5/24	1,495,833
		国債・機関債合計	1,495,833
		米国合計(簿価 \$1,495,833)	1,495,833
		グランド・ケイマン(0.0%)	
		定期預金(0.0%)	
		Brown Brothers Harriman & Co.	
EUR	0 ⁽²⁾	-0.58% due 2018/3/1	1
JPY	46,634	-0.31% due 2018/3/1	437
GBP	6	0.23% due 2018/3/1	8
CAD	54	0.55% due 2018/3/1	42
AUD	912	0.63% due 2018/3/1	710
NZD	55	0.90% due 2018/3/1	40
ZAR	1,419	5.70% due 2018/3/1	120
		定期預金合計	1,358
		グランド・ケイマン合計(簿価 \$1,358)	1,358
		スウェーデン(2.5%)	
		定期預金(2.5%)	
		Skandinaviska Enskilda Banken AB	
USD	551,971	0.78% due 2018/3/1	551,971
		定期預金合計	551,971
		スウェーデン合計(簿価 \$551,971)	551,971
		短期投資合計(簿価 \$2,049,162)	2,049,162
		対純資産	
		比率	
		投資総額(簿価 \$27,192,723)	122.1%
		現金および他の資産を超過する負債	(22.1)
		純資産	100.0%
			\$ 27,285,425
			(4,942,422)
			\$ 22,343,003

(1) この証券のすべてもしくは一部が2018年2月28日時点の先物取引の担保として取引相手に差し入れられています。

(2) 0.5未満

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最善の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

用語集:

TBA To be announced(事後告知)の略。米国政府機関によって発行される不動産ローン担保証券の先渡取引で、合意された将来の決済日に受渡しがされます。

- 償還条項付き証券。
- 2018年2月28日時点の変動金利証券。
- 永久債。
- 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家に転売が可能です。他に指定がない限り、これらの証券は非流動的だとはみなされません。
- 発行日取引または繰延受渡しベースで購入された証券。

2018年2月28日時点で、以下の先物取引によりブローカーに対し現金\$1,013の未払金があります。

2018年2月28日時点の先物取引(純資産の-0.1%)

ポジション	銘柄	限月	枚数	評価益/(損)
Long	Brazil Real April Futures	2018年3月	4	\$ 840
Short	Euro-OAT March Futures	2018年3月	(4)	(5,086)
Long	Mexican Peso March Futures	2018年3月	9	4,591
Short	U.S. Treasury 10 Year Note (CBT) June Futures	2018年6月	(21)	(4,248)
Short	U.S. Treasury 10 Year Ultra June Futures	2018年6月	(11)	(5,823)
Long	U.S. Treasury 5 Year Note (CBT) June Futures	2018年6月	2	281

Short	U.S. Treasury Long Bond (CBT) June Futures	2018年6月	(8)	(8,516)
				<u>\$ (17,961)</u>

2018年2月28日時点で、以下の中央清算対象スワップ契約によりブローカーに対し現金\$36,700の未収金があります。

2018年2月28日時点の中央清算対象のクレジット・デフォルト・スワップ契約(純資産の0.0%)

通貨	取引相手	想定元本	信用プロ		受取/ (支払)	インプライド 信用スプレッド	満期日	評価益/(損)
			テクニ	ン				
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	218,250	Sell	CDX.EM.28 Index	1.000%	1.41%	2022/12/20	\$ 7,822

2018年2月28日時点の中央清算対象の金利スワップ契約(純資産の0.0%)

通貨	取引相手	想定元本	指標金利	受取/(支払)	満期日	評価益/(損)
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	130,000	3-Month USD-LIBOR	Receive, 2.426%	2027/12/7	\$ 4,808
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	130,000	3-Month USD-LIBOR	Receive, 2.432%	2027/12/7	4,627
						<u>\$ 9,435</u>

2018年2月28日時点の通貨セレクトクラス外国為替先渡契約(純資産の0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
CNY	Citibank N.A.	1,199,958	2018/3/13	USD	190,270	\$ -	\$ (874)	\$ (874)
IDR	Citibank N.A.	2,591,624,948	2018/3/13	USD	190,576	-	(2,219)	(2,219)
INR	Citibank N.A.	12,910,405	2018/3/13	USD	199,618	-	(1,708)	(1,708)
MXN	Citibank N.A.	3,639,847	2018/3/13	USD	192,550	17	-	17
RUB	Citibank N.A.	11,014,368	2018/3/13	USD	191,209	4,106	-	4,106
TRY	Citibank N.A.	806,402	2018/3/13	USD	211,117	22	-	22
						\$ 4,145	\$ (4,801)	\$ (656)

2018年2月28日時点の円ヘッジクラス外国為替先渡契約(純資産の1.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	Citibank N.A.	1,112,135,733	2018/3/13	USD	10,174,837	\$ 254,801	\$ -	\$ 254,801

2018年2月28日時点の円ヘッジN1クラス外国為替先渡契約(純資産の0.6%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	Citibank N.A.	600,500,141	2018/3/13	USD	5,495,801	\$ 135,706	\$ -	\$ 135,706

通貨の略称

AUD	-	オーストラリア・ドル
CAD	-	カナダ・ドル
CNY	-	人民元
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
IDR	-	インドネシア・ルピア
INR	-	インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
NZD	-	ニュージーランド・ドル
RUB	-	ロシア・ルーブル
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

「ダイワ・マネー・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

	2019年3月27日現在	2019年9月27日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,011,420,851	73,247,979,759
現先取引勘定	999,998,739	999,996,671
流動資産合計	78,011,419,590	74,247,976,430
資産合計	78,011,419,590	74,247,976,430
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	-	8,919
流動負債合計	-	8,919
負債合計	-	8,919
純資産の部		
元本等		
元本	1 76,645,501,353	72,973,187,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,365,918,237	1,274,779,675
元本等合計	78,011,419,590	74,247,967,511
純資産合計	78,011,419,590	74,247,967,511
負債純資産合計	78,011,419,590	74,247,976,430

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

自 2019年3月28日
至 2019年9月27日
該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年3月27日現在	2019年9月27日現在
1. 1 期首	2018年3月28日	2019年3月28日
期首元本額	68,461,510,603円	76,645,501,353円
期中追加設定元本額	211,947,321,878円	54,149,834,656円
期中一部解約元本額	203,763,331,128円	57,822,148,173円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日経225 - シフト11 - 2019-03 (適格機関投資家専 用)	589,507円	- 円
ダイワ・グローバルIoT関連 株ファンド - AI新時代 - (為替ヘッジあり)	977,694円	977,694円
ダイワ・グローバルIoT関連 株ファンド - AI新時代 - (為替ヘッジなし)	977,694円	977,694円
ダイワFEグローバル・バ リュウ(為替ヘッジあり)	98,069円	98,069円
ダイワFEグローバル・バ リュウ(為替ヘッジなし)	98,069円	98,069円
NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジあり)	49,107円	49,107円
NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジなし)	49,107円	49,107円
ダイワ/“RICI®”コモ ディティ・ファンド	5,024,392円	5,024,392円
US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジあり/年1回決 算型)	1,676円	1,676円
US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決 算型)	1,330円	1,330円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>米ド ルコース	981円	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>円 コース	981円	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>世界 通貨分散コース	981円	981円

NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジあり/ 隔月分配型)	180,729円	180,729円
NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジなし/ 隔月分配型)	737,649円	737,649円
NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジあり/ 資産成長型)	95,276円	95,276円
NWQグローバル厳選証券 ファンド(為替ヘッジなし/ 資産成長型)	337,885円	337,885円
世界セレクトティブ株式オーブ ン	- 円	983円
DCダイワ・マネー・ポート フォリオ	4,002,785,928円	4,159,163,148円
ダイワファンドラップ コモ ディティセレクト	317,088,630円	317,107,941円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプル リターンズ - 日本円・コー ス(毎月分配型)	132,757円	132,757円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプル リターンズ - 豪ドル・コー ス(毎月分配型)	643,132円	643,132円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプル リターンズ - ブラジル・レ アル・コース(毎月分配型)	4,401,613円	4,401,613円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプル リターンズ - 米ドル・コー ス(毎月分配型)	12,784円	12,784円
ダイワノフィデリティ北米株 式ファンド - パラダイムシ フト -	9,853,995円	9,853,995円
低リスク型アロケーション ファンド2(適格機関投資家 専用)	13,743,005,794円	4,212,646,194円
ブルベア・マネー・ポート フォリオ	21,470,406,821円	27,676,395,240円

ブル3倍日本株ポートフォリオ	33,892,695,849円	31,161,127,167円
ベア2倍日本株ポートフォリオ	3,093,762,511円	5,324,691,832円
ダイワFEグローバル・バリュー株ファンド(ダイワSMA専用)	160,930円	160,930円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)	155,317円	155,317円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)	38,024円	38,024円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)米ドル・コース(毎月分配型)	4,380円	4,380円
ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)豪ドル・コース(毎月分配型)	22,592円	22,592円
ダイワノアムンディ食糧増産関連ファンド	164,735円	164,735円
ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	91,334,414円	88,223,432円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース)	33,689円	33,689円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨コース)	96,254円	96,254円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジあり)	988,283円	988,283円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジなし)	4,926,018円	4,926,018円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)米ドルコース	285,029円	285,029円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)日本円コース	144,570円	144,570円
ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)通貨コース	677,850円	677,850円
ダイワ英国高配当株ツイン(毎月分配型)	98,107円	98,107円

ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円	98,107円
ダイワ英国高配当株ファン ド・マネー・ポートフォリオ	980,367円	980,367円
ダイワ米国高金利社債ファン ド(通貨選択型)南アフリ カ・ランド・コース(毎月分 配型)	1,097円	1,097円
ダイワ米国高金利社債ファン ド(通貨選択型)トルコ・リ ラ・コース(毎月分配型)	2,690円	2,690円
ダイワ米国高金利社債ファン ド(通貨選択型)通貨セレクト ・コース(毎月分配型)	1,350円	1,350円
ダイワ・オーストラリア高配 当株(毎月分配型)株式 コース	98,203円	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配 当株(毎月分配型)通貨 コース	98,203円	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配 当株(毎月分配型)株 式&通貨ツインコース	982,029円	982,029円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプル リターンズ - 通貨セレクト・ コース(毎月分配型)	98,174円	98,174円
計	76,645,501,353円	72,973,187,836円
2. 期末日における受益権の総数	76,645,501,353口	72,973,187,836口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月27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	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

2019年3月27日現在	2019年9月27日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年3月27日現在	2019年9月27日現在
1口当たり純資産額	1.0178円	1.0175円
(1万口当たり純資産額)	(10,178円)	(10,175円)

【US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)】

(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(2019年3月28日から2019年9月27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。

US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	630,548	451,216
投資信託受益証券	34,347,935	28,325,252
親投資信託受益証券	1,353	1,353
流動資産合計	34,979,836	28,777,821
資産合計	34,979,836	28,777,821
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	8,144	4,915
未払委託者報酬	300,670	181,852
その他未払費用	1,944	1,148
流動負債合計	310,758	187,915
負債合計	310,758	187,915
純資産の部		
元本等		
元本	1 29,843,056	1 24,834,829
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,826,022	3,755,077
(分配準備積立金)	2,067,171	1,649,744
元本等合計	34,669,078	28,589,906
純資産合計	34,669,078	28,589,906
負債純資産合計	34,979,836	28,777,821

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2018年3月28日 至 2018年9月27日	当中間計算期間 自 2019年3月28日 至 2019年9月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,124,020	22,683
営業収益合計	5,124,020	22,683
営業費用		
支払利息	198	80
受託者報酬	11,663	4,915
委託者報酬	429,441	181,852
その他費用	2,838	1,148
営業費用合計	444,140	187,995
営業利益又は営業損失()	4,679,880	210,678
経常利益又は経常損失()	4,679,880	210,678
中間純利益又は中間純損失()	4,679,880	210,678
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	575,201	62,466
期首剰余金又は期首欠損金()	6,948,733	4,826,022
剰余金増加額又は欠損金減少額	220,951	203,247
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	220,951	203,247
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,305,332	1,001,048
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,305,332	1,001,048
中間剰余金又は中間欠損金()	9,969,031	3,755,077

(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 2019年3月28日	至 2019年9月27日
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、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>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。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	2019年3月27日現在	2019年9月27日現在
1. 1 期首元本額	67,797,373円	29,843,056円
期中追加設定元本額	1,810,740円	1,165,474円
期中一部解約元本額	39,765,057円	6,173,701円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	29,843,056口	24,834,829口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2018年3月28日 至 2018年9月27日	自 2019年3月28日 至 2019年9月27日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2019年3月27日現在	当中間計算期間末 2019年9月27日現在
1口当たり純資産額	1.1617円	1.1512円
(1万口当たり純資産額)	(11,617円)	(11,512円)

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジ/N1クラス)」の受益証券(円建)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「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネー・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、同ファンドの状況及び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。

「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワ/NB・ストラテジック・インカム・ファンド(ノンヘッジ/N1クラス)」の状況

前記「US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の状況

前記「US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)」に記載のとおりであります。

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2019年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 【事業の内容及び営業の状況】

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

2019年9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	63	119,570
追加型株式投資信託	712	15,788,257
株式投資信託 合計	775	15,907,827
単位型公社債投資信託	28	94,090
追加型公社債投資信託	14	1,400,808
公社債投資信託 合計	42	1,494,898
総合計	817	17,402,725

(3) 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

5 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

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

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

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

当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

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

(損益計算書)

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

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

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

264百万円

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2019年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日至2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

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

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬		12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		7,631	7,631	-
資産計		48,709	48,709	-
(1) 未払手数料		(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金		(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)		(3,286)	(3,286)	-
負債計		(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-

有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

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

当事業年度(2019年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	87	55	32
(2) その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	389	86	-
(2) その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

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

前事業年度（2018年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2019年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注1)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

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

(注3)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525
-----------------	-----------	-----------

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月1日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているUS債券NB戦略ファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）の2019年3月28日から2019年9月27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、US債券NB戦略ファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）の2019年9月27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（2019年3月28日から2019年9月27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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月1日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているUS債券NB戦略ファンド（為替ヘッジなし/年1回決算型）の2019年3月28日から2019年9月27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、US債券NB戦略ファンド（為替ヘッジなし/年1回決算型）の2019年9月27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（2019年3月28日から2019年9月27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。