

【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5月31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】** i F r e e 8 資産バランス

**【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11月30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】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

iFree 8資産バランス

SIMPLE
& EASY

インデックスってなに？

FREE
& LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



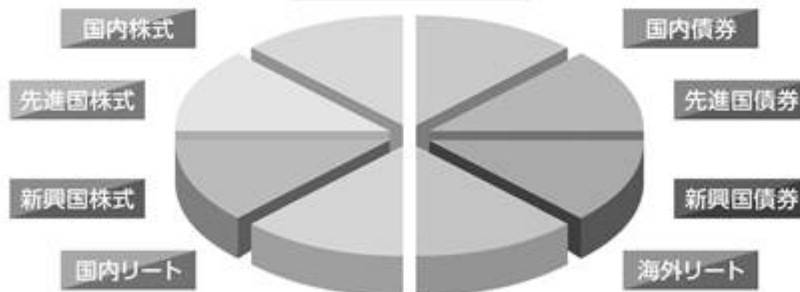
これらの質問については、以降でご説明します。

ファンドの目的・特色

値動きの異なる8つの資産クラスに均等分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 8つの資産クラスについて

資産配分のイメージ



・各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果をそれぞれの対象インデックスに連動させることをめざして運用を行ないます。

※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。

※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。

当ファンドは、「つみたてNISA」対象ファンドです。



「インデックス」とは

いうなれば「市場のモノサシ」です。

マーケット（市場）を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、

「〇〇指数」「〇〇インデックス」などと呼ばれます。

インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット

一般に
インデックスの上昇時はマーケットは好調
インデックスの下落時はマーケットは低調
と考えられます。

当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

■ 対象インデックスについて

資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数 (TOPIX)
先進国株式	MSCIコクサイ指数 (円ベース)
新興国株式	FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数

資産クラス	対象インデックス
先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券	JPモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-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 (円換算)
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)

※対象インデックスの内容については、後掲の「インデックスの概要について」をご参照下さい。



ファンドへの投資にかかる主な費用は



当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

運用管理費用っていくらくらい？

— Aさんの場合 —

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.2376%(税込)です。
1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	÷	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.2376%		238円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

■ インデックスの概要について

< 略 >

● FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社 (FTSE International Limited) の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリアーした新興国の上場株の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、リサーチ・アフィリエイツ社 (Research Affiliates LLC) 独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。なお、FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)は、FTSE RAFI エマージング インデックス(米ドルベース)をもとに、FTSE International Limited の承諾を得て委託会社が計算したものです。

「iFree 8資産バランス」は、いかなる形式においてもFTSE International Limited (以下「FTSE」)、ロンドン証券取引所グループ会社 (以下「LSEG」)、またはResearch Affiliates LLC (以下「RA」) (以下、総称して「ライセンサ各社」) によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については(過失の有無に関わらず)何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE®はLSEGの商標です。Fundamental Index®およびRAFI®はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

The iFree Balanced Fund 8 is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

< 略 >

● FTSE世界国債インデックス

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

< 略 >

● 東証REIT指数(配当込み)

東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、2003年4月より算出・公表されています。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所 (以下「(株)東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

< 略 >

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
 - (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
 - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
 - (c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的
- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（2018年3月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

< 更新後 >

主要投資対象

下記の各マザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

< 略 >

5．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

< 略 >

(3) 【運用体制】

< 更新後 >

< 略 >

上記の運用体制は2018年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(5) 【投資制限】

< 更新後 >

< 略 >

< 参考 > マザーファンドの概要

< 略 >

5．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

< 略 >

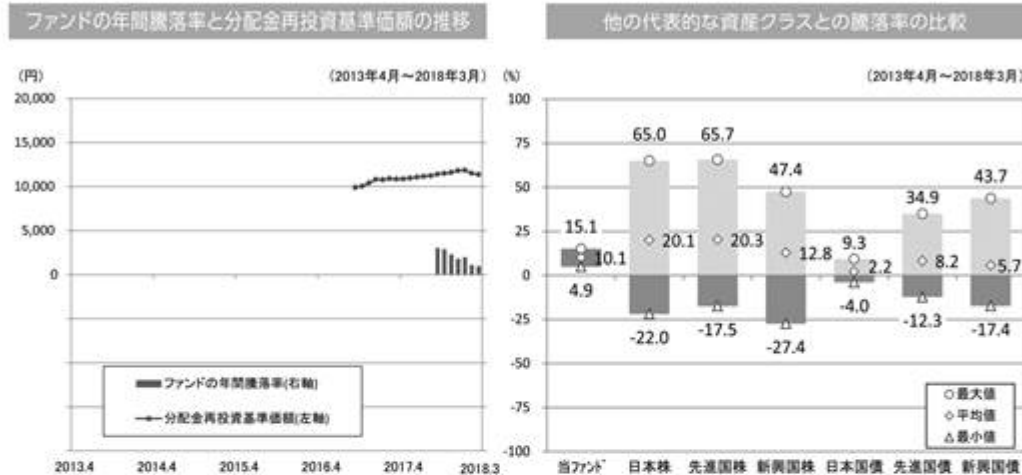
3 【投資リスク】

< 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、高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>

「つみたてNISA」をご利用の場合

販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

毎年、年間40万円の範囲で販売会社との契約に基づいて定期かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。

< 略 >

() 上記は、2018年3月末現在のものですので、税法または確定拠出年金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30年3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	6,880,358,747	99.00
内 日本	6,880,358,747	99.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	69,476,326	1.00
純資産総額	6,949,835,073	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30年3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	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	433,470,815	2.1546 933,993,509	2.0126 872,403,362	12.55
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	806,121,399	1.0222 824,095,682	1.0775 868,595,807	12.50
3	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	612,964,578	1.4012 858,946,481	1.4060 861,828,196	12.40
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	354,373,426	2.3563 835,011,970	2.4294 860,914,801	12.39
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	316,501,482	2.7668 875,725,535	2.7193 860,662,480	12.38
6	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	374,615,589	2.2654 848,674,778	2.2784 853,524,157	12.28
7	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	668,879,814	1.2694 849,111,656	1.2742 852,286,658	12.26
8	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	525,103,945	1.5628 820,637,489	1.6190 850,143,286	12.23

(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	99.00%
合計	99.00%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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)
平成29年3月末日	2,316,763,967	-	1.0843	-
4月末日	2,819,174,652	-	1.0867	-
5月末日	3,139,740,680	-	1.0957	-
6月末日	3,537,618,121	-	1.1063	-
7月末日	3,978,924,085	-	1.1154	-
8月末日	4,394,352,645	-	1.1228	-
第1計算期間末 (平成29年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
9月末日	4,753,192,406	-	1.1393	-
10月末日	5,193,485,236	-	1.1495	-
11月末日	5,594,767,626	-	1.1595	-
12月末日	5,918,842,545	-	1.1795	-
平成30年1月末日	6,411,024,271	-	1.1850	-
2月末日	6,615,319,079	-	1.1499	-
3月末日	6,949,835,073	-	1.1370	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成29年9月8日～ 平成30年3月7日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
平成29年9月8日～ 平成30年3月7日	1.1

(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	5,119,041,794	1,173,761,616
平成29年9月8日～ 平成30年3月7日	2,906,430,543	1,043,879,258

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	138,168,116,390	98.03
内 日本	138,168,116,390	98.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,770,708,622	1.97
純資産総額	140,938,825,012	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)	2,780,730,000	1.97
内 日本	2,780,730,000	1.97

(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30年3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	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	684,600	6,737.47 4,612,475,800	6,825.00 4,672,395,000	3.32
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,891,200	709.35 2,760,239,241	697.00 2,712,166,400	1.92
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	250,500	8,906.86 2,231,168,481	7,950.00 1,991,475,000	1.41
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	396,500	5,132.45 2,035,018,429	4,900.00 1,942,850,000	1.38
5	ソニー	日本	株式	電気機器	376,800	4,315.55 1,626,099,334	5,146.00 1,939,012,800	1.38
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	420,300	4,294.79 1,805,101,641	4,458.00 1,873,697,400	1.33
7	本田技研	日本	株式	輸送用機器	506,700	3,304.69 1,674,487,941	3,660.00 1,854,522,000	1.32

8	キーエンス	日本	株式	電気機器	27,700	60,301.03 1,670,338,593	66,040.00 1,829,308,000	1.30
9	任天堂	日本	株式	その他製品	34,700	41,082.05 1,425,547,285	46,860.00 1,626,042,000	1.15
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,537,200	195.89 1,476,463,585	191.40 1,442,620,080	1.02
11	ファナック	日本	株式	電気機器	53,500	22,832.89 1,221,559,774	26,960.00 1,442,360,000	1.02
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	497,500	2,976.25 1,480,687,154	2,716.50 1,351,458,750	0.96
13	キヤノン	日本	株式	電気機器	302,600	3,843.36 1,163,001,239	3,853.00 1,165,917,800	0.83
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	389,700	2,627.11 1,023,785,246	2,862.00 1,115,321,400	0.79
15	日本電産	日本	株式	電気機器	67,900	13,795.08 936,686,520	16,390.00 1,112,881,000	0.79
16	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	408,900	2,587.44 1,058,008,189	2,716.50 1,110,776,850	0.79
17	花王	日本	株式	化学	138,700	6,864.32 952,081,569	7,981.00 1,106,964,700	0.79
18	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	416,100	2,483.36 1,033,326,825	2,644.50 1,100,376,450	0.78
19	信越化学	日本	株式	化学	98,300	10,179.71 1,000,666,079	11,005.00 1,081,791,500	0.77
20	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	350,000	3,708.80 1,298,081,407	3,066.00 1,073,100,000	0.76
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	206,900	6,185.16 1,279,710,876	5,183.00 1,072,362,700	0.76
22	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	232,600	4,408.82 1,025,492,466	4,564.00 1,061,586,400	0.75
23	日立	日本	株式	電気機器	1,348,000	793.88 1,070,155,924	770.80 1,039,038,400	0.74
24	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	50,600	19,538.19 988,632,828	20,130.00 1,018,578,000	0.72
25	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	101,600	10,194.68 1,035,779,761	9,862.00 1,001,979,200	0.71
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	209,100	4,533.13 947,878,283	4,735.00 990,088,500	0.70
27	パナソニック	日本	株式	電気機器	643,600	1,651.24 1,062,738,082	1,521.00 978,915,600	0.69
28	小松製作所	日本	株式	機械	271,900	3,181.50 865,051,761	3,547.00 964,429,300	0.68
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	563,700	1,755.63 989,652,286	1,701.50 959,135,550	0.68
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	577,100	1,467.69 847,006,456	1,614.00 931,439,400	0.66

(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。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.03%

合計	98.03%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.32%
建設業	3.13%
食料品	4.27%
繊維製品	0.69%
パルプ・紙	0.27%
化学	7.19%
医薬品	4.63%
石油・石炭製品	0.67%
ゴム製品	0.86%
ガラス・土石製品	0.95%
鉄鋼	1.04%
非鉄金属	0.89%
金属製品	0.66%
機械	5.36%
電気機器	13.65%
輸送用機器	8.59%
精密機器	1.59%
その他製品	2.22%
電気・ガス業	1.58%
陸運業	3.88%
海運業	0.20%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.19%
卸売業	4.58%
小売業	4.82%
銀行業	6.90%
証券、商品先物取引業	0.97%
保険業	2.13%
その他金融業	1.22%
不動産業	2.32%
サービス業	4.37%
合計	98.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年6月	買建	162	2,751,777,480	2,780,730,000	1.97%

(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。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3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	208,037,689,120	98.04
内 日本	208,037,689,120	98.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,160,554,174	1.96
純資産総額	212,198,243,294	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,357,000,000	1.58
内 日本	3,357,000,000	1.58

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

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

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

(2) 投資資産 (平成30年3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	日本ビルファンド	日本	投資証券	25,652	579,000.00 14,852,508,000	588,000.00 15,083,376,000	7.11
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	25,038	550,000.00 13,770,900,000	551,000.00 13,795,938,000	6.50
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	78,393	144,900.00 11,359,145,700	146,800.00 11,508,092,400	5.42
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	50,059	203,400.00 10,182,000,600	204,200.00 10,222,047,800	4.82
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	58,423	168,100.00 9,820,906,300	166,800.00 9,744,956,400	4.59
6	オリックス不動産投資	日本	投資証券	52,560	165,800.00 8,714,448,000	163,200.00 8,577,792,000	4.04
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	35,307	232,600.00 8,212,408,200	229,000.00 8,085,303,000	3.81
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	30,823	249,067.72 7,677,014,421	254,600.00 7,847,535,800	3.70

9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	24,525	278,600.00 6,832,665,000	275,100.00 6,746,827,500	3.18
10	GLP投資法人	日本	投資証券	54,990	116,900.00 6,428,331,000	115,700.00 6,362,343,000	3.00
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	16,724	373,000.00 6,238,052,000	379,000.00 6,338,396,000	2.99
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	76,455	77,200.00 5,902,326,000	75,700.00 5,787,643,500	2.73
13	API投資法人	日本	投資証券	11,984	469,500.00 5,626,488,000	472,500.00 5,662,440,000	2.67
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	7,743	662,000.00 5,125,866,000	653,000.00 5,056,179,000	2.38
15	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,802	475,500.00 4,185,351,000	465,500.00 4,097,331,000	1.93
16	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	9,011	438,000.00 3,946,818,000	433,500.00 3,906,268,500	1.84
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	28,456	135,200.00 3,847,251,200	135,600.00 3,858,633,600	1.82
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,646	218,500.00 3,855,651,000	218,500.00 3,855,651,000	1.82
19	産業ファンド	日本	投資証券	30,775	119,600.00 3,680,690,000	119,500.00 3,677,612,500	1.73
20	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	72,650	49,150.00 3,570,747,500	49,050.00 3,563,482,500	1.68
21	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	5,713	620,000.00 3,542,060,000	616,000.00 3,519,208,000	1.66
22	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	23,721	142,400.00 3,377,870,400	139,700.00 3,313,823,700	1.56
23	森トラスト総合リート	日本	投資証券	18,932	159,500.00 3,019,654,000	156,300.00 2,959,071,600	1.39
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	17,990	161,200.00 2,899,988,000	163,000.00 2,932,370,000	1.38
25	イオンリート投資	日本	投資証券	25,155	113,100.00 2,845,030,500	112,300.00 2,824,906,500	1.33
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	23,926	111,000.00 2,655,786,000	111,600.00 2,670,141,600	1.26
27	東急リアル・エステート	日本	投資証券	17,760	143,300.00 2,545,008,000	146,700.00 2,605,392,000	1.23
28	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	10,041	245,900.00 2,469,081,900	249,000.00 2,500,209,000	1.18
29	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	29,795	83,000.00 2,472,985,000	81,100.00 2,416,374,500	1.14
30	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	16,616	144,400.00 2,399,350,400	144,500.00 2,401,012,000	1.13

(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	98.04%
合計	98.04%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2018年6月	買建	2,000	3,351,000,000	3,357,000,000	1.58%

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（平成30年3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	12,194,509,880	79.22
内 日本	12,194,509,880	79.22
地方債証券	1,245,905,500	8.09
内 日本	1,245,905,500	8.09
特殊債券	817,008,100	5.31
内 日本	817,008,100	5.31
社債券	1,024,617,800	6.66
内 日本	1,024,617,800	6.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	111,089,881	0.72
純資産総額	15,393,131,161	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30年3月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	128 5年国債	日本	国債証券	167,000,000	100.79 168,324,660	100.70 168,184,030	0.100000 2021/06/20	1.09

2	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.38 167,017,600	104.10 166,571,200	0.800000 2022/09/20	1.08
3	126 5年国債	日本	国債証券	164,000,000	100.71 165,164,720	100.59 164,982,360	0.100000 2020/12/20	1.07
4	334 10年国債	日本	国債証券	156,000,000	104.43 162,921,720	104.24 162,623,760	0.600000 2024/06/20	1.06
5	380 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.41 160,671,800	100.34 160,558,400	0.100000 2019/09/15	1.04
6	338 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	103.40 157,177,120	103.25 156,941,520	0.400000 2025/03/20	1.02
7	343 10年国債	日本	国債証券	152,000,000	100.98 153,494,160	100.98 153,500,240	0.100000 2026/06/20	1.00
8	345 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	100.87 151,306,500	0.100000 2026/12/20	0.98
9	348 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.67 151,007,000	100.75 151,132,500	0.100000 2027/09/20	0.98
10	349 10年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.34 150,518,750	100.67 151,017,000	0.100000 2027/12/20	0.98
11	125 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.68 151,030,500	100.54 150,816,000	0.100000 2020/09/20	0.98
12	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.95 146,939,800	104.53 146,346,200	1.100000 2021/12/20	0.95
13	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	104.42 146,189,400	104.03 145,654,600	0.900000 2022/03/20	0.95
14	335 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.92 145,496,400	103.73 145,229,000	0.500000 2024/09/20	0.94
15	346 10年国債	日本	国債証券	143,000,000	100.78 144,126,840	100.80 144,151,150	0.100000 2027/03/20	0.94
16	133 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.05 131,369,600	100.96 131,254,500	0.100000 2022/09/20	0.85
17	347 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.76 130,989,300	100.78 131,016,600	0.100000 2027/06/20	0.85
18	130 5年国債	日本	国債証券	127,000,000	100.93 128,186,180	100.80 128,018,540	0.100000 2021/12/20	0.83
19	11兵庫県公債20年	日本	地方債証券	100,000,000	118.05 118,053,000	118.39 118,397,700	1.840000 2030/08/16	0.77
20	32東日本旅客鉄道	日本	社債券	100,000,000	113.27 113,278,800	112.67 112,677,900	2.260000 2024/03/19	0.73
21	129 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.87 110,964,700	100.76 110,841,500	0.100000 2021/09/20	0.72
22	309 10年国債	日本	国債証券	103,000,000	103.15 106,244,500	102.73 105,811,900	1.100000 2020/06/20	0.69
23	25 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.65 103,656,700	103.60 103,602,200	0.694000 2023/11/22	0.67
24	116 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.73 103,739,100	103.53 103,531,600	0.800000 2022/11/25	0.67
25	33 中日本高速道	日本	社債券	100,000,000	103.73 103,730,200	103.51 103,512,100	1.084000 2021/09/17	0.67
26	36 地方公共団体	日本	特殊債券	100,000,000	103.74 103,740,800	103.47 103,474,700	0.892000 2022/05/27	0.67

27	24 - 16 愛知県公債	日本	地方債証券	100,000,000	103.63 103,633,300	103.46 103,469,300	0.757000 2023/01/31	0.67
28	117 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	103.39 103,391,700	103.21 103,211,300	0.720000 2022/12/22	0.67
29	308 10年国債	日本	国債証券	100,000,000	103.66 103,661,000	103.17 103,174,000	1.300000 2020/06/20	0.67
30	3 兵庫県公債12年	日本	地方債証券	100,000,000	103.30 103,304,200	103.14 103,143,600	0.560000 2025/04/16	0.67

(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	79.22%
地方債証券	8.09%
特殊債券	5.31%
社債券	6.66%
合計	99.28%

(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。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	4,741,943,810	93.61
内 中国	1,435,167,235	28.33
内 台湾	733,943,608	14.49
内 タイ	188,547,901	3.72
内 マレーシア	122,848,165	2.43
内 インドネシア	74,638,103	1.47
内 インド	349,413,728	6.90
内 ポーランド	64,392,900	1.27
内 ロシア	448,079,685	8.85
内 トルコ	90,386,713	1.78
内 メキシコ	183,019,689	3.61

	内 チリ	59,878,129	1.18
	内 ブラジル	662,741,560	13.08
	内 南アフリカ	328,886,394	6.49
投資証券		181,266,423	3.58
	内 アメリカ	162,350,656	3.21
	内 メキシコ	6,178,162	0.12
	内 南アフリカ	12,737,605	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		142,219,216	2.81
純資産総額		5,065,429,449	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)	50,476,749	1.00
内 アメリカ	50,476,749	1.00
為替予約取引(買建)	12,536,281	0.25
内 日本	12,536,281	0.25
為替予約取引(売建)	65,981	0.00
内 日本	65,981	0.00

(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。

(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30年3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	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	1,868,000	89.52 167,251,776	109.13 203,859,323	4.02
2	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	アメリカ	投資証券	-	65,000	2,401.13 156,075,940	2,497.70 162,350,656	3.21
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	160,000	785.79 125,728,359	888.16 142,105,600	2.81
4	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	1,400,000	71.15 99,616,173	91.12 127,573,880	2.52
5	GAZPROM PAO -SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	219,470	445.14 97,698,843	516.96 113,458,054	2.24
6	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	電気通信サービス	106,500	1,069.24 113,875,446	974.20 103,752,620	2.05
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	1,805,000	54.41 98,243,650	57.13 103,135,534	2.04
8	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	310,128	374.03 116,000,721	327.60 101,597,933	2.01

9	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	12,270	5,353.22 65,684,169	7,319.93 89,815,615	1.77
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	50,324	1,281.60 64,495,526	1,648.59 82,963,658	1.64
11	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	847,800	84.11 71,314,505	93.29 79,091,771	1.56
12	VALE SA	ブラジル	株式	素材	50,790	970.71 49,303,774	1,356.20 68,881,769	1.36
13	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	34,590	1,164.39 40,278,986	1,979.25 68,462,299	1.35
14	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	47,940	983.37 47,142,940	1,269.13 60,842,332	1.20
15	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	86,300	407.02 35,127,008	687.90 59,366,055	1.17
16	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	375,000	120.15 45,061,434	156.52 58,695,900	1.16
17	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	電気通信 サービス	516,600	87.03 44,964,530	100.91 52,131,398	1.03
18	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	27,900	1,309.20 36,526,910	1,863.20 51,983,280	1.03
19	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	67,300	451.90 30,415,526	750.55 50,512,473	1.00
20	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	37,200	1,044.96 38,872,973	1,318.29 49,040,533	0.97
21	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	28,040	1,216.00 34,096,881	1,456.45 40,838,998	0.81
22	SASOL LTD	南アフリカ	株式	素材	11,000	3,392.85 37,321,400	3,621.00 39,831,059	0.79
23	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	33,500	756.22 25,333,509	1,080.49 36,196,482	0.71
24	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	492,000	67.65 33,292,500	72.98 35,906,455	0.71
25	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	574,000	53.07 30,468,710	60.38 34,662,942	0.68
26	STANDARD BANK GROUP LTD	南アフリカ	株式	金融	16,650	1,384.69 23,055,356	1,963.74 32,696,378	0.65
27	MTN GROUP LTD	南アフリカ	株式	電気通信 サービス	28,210	1,056.89 29,815,019	1,068.79 30,150,837	0.60
28	AMBEV SA	ブラジル	株式	生活必需品	36,700	605.10 22,207,760	773.36 28,382,646	0.56
29	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	4,800	3,983.96 19,123,078	5,545.98 26,620,723	0.53
30	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	14,200	1,666.68 23,666,936	1,867.47 26,518,074	0.52

(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。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.61%
投資証券	3.58%
合計	97.19%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	16.80%
素材	8.95%
資本財・サービス	2.60%
一般消費財・サービス	3.89%
生活必需品	4.85%
ヘルスケア	0.68%
金融	31.06%
情報技術	11.93%
電気通信サービス	7.60%
公益事業	3.12%
不動産	2.15%
合計	93.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	MINI MSCI EMG MKT 2018年6月	買建	8	52,255,844	50,476,749	1.00%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年4月	買建	622	65,981	66,041	0.00%
		米ドル買/円売 2018年6月	買建	118,000	12,423,004	12,470,240	0.25%
		チリ・ペソ売/円買 2018年4月	売建	375,533	65,981	65,981	0.00%

(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) 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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成30年3月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		89,812,069,265	95.62
	内 香港	1,301,681,667	1.39
	内 シンガポール	473,520,119	0.50
	内 イスラエル	171,944,933	0.18

内 ノルウェー	261,131,604	0.28
内 スウェーデン	1,010,570,448	1.08
内 デンマーク	689,862,852	0.73
内 イギリス	6,478,737,006	6.90
内 アイルランド	174,779,020	0.19
内 オランダ	1,393,366,669	1.48
内 ベルギー	432,299,521	0.46
内 フランス	4,032,930,149	4.29
内 ドイツ	3,690,080,844	3.93
内 スイス	2,984,029,212	3.18
内 ポルトガル	57,638,317	0.06
内 スペイン	1,229,308,581	1.31
内 イタリア	957,233,084	1.02
内 フィンランド	387,150,087	0.41
内 オーストリア	100,648,475	0.11
内 カナダ	3,417,553,783	3.64
内 アメリカ	58,288,692,660	62.06
内 オーストラリア	2,218,536,479	2.36
内 ニューージーランド	60,373,755	0.06
投資証券	2,310,948,301	2.46
内 香港	67,705,281	0.07
内 シンガポール	42,526,102	0.05
内 イギリス	84,139,133	0.09
内 フランス	121,199,109	0.13
内 カナダ	16,389,583	0.02
内 アメリカ	1,685,859,293	1.79
内 オーストラリア	293,129,800	0.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,807,614,041	1.92
純資産総額	93,930,631,607	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)	1,839,189,696	1.96
内 アメリカ	1,839,189,696	1.96
為替予約取引(買建)	721,956,000	0.77
内 日本	721,956,000	0.77

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

(注2) 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30年3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	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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	122,600	18,022.34 2,209,546,161	17,824.94 2,185,338,527	2.33
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	174,900	8,895.79 1,555,879,562	9,696.52 1,695,922,188	1.81
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	9,770	124,595.93 1,217,302,510	153,765.40 1,502,287,974	1.60
4	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	82,820	11,046.94 914,909,388	11,683.21 967,603,684	1.03
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	56,700	18,640.02 1,056,890,394	16,976.08 962,544,280	1.02
6	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	63,950	14,831.63 948,486,179	13,614.65 870,657,251	0.93
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	7,487	109,030.07 816,308,423	109,617.36 820,705,246	0.87
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	100,855	8,732.82 880,751,969	7,926.56 799,433,854	0.85
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,080	110,603.38 783,072,167	110,185.75 780,115,135	0.83
10	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	235,701	3,017.21 711,183,111	3,186.13 750,975,818	0.80
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	30,200	20,260.49 611,869,169	21,192.75 640,021,207	0.68
12	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	75,700	9,430.76 713,913,232	8,418.77 637,301,237	0.68
13	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	111,122	6,038.46 671,008,723	5,568.03 618,731,563	0.66
14	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	111,250	4,683.80 521,076,922	5,532.97 615,543,936	0.66
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	145,841	3,878.92 565,709,108	3,787.45 552,366,370	0.59
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	43,150	11,710.30 505,300,962	12,708.42 548,368,703	0.58
17	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	45,118	12,462.90 562,304,468	12,115.60 546,632,074	0.58
18	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	117,500	3,997.59 469,723,438	4,556.63 535,404,448	0.57
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	141,463	3,848.11 544,375,112	3,770.45 533,380,243	0.57
20	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,126	23,694.81 547,968,696	22,735.36 525,777,935	0.56
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	27,700	18,863.65 522,524,070	18,936.21 524,533,228	0.56
22	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	60,267	9,476.50 571,125,115	8,422.70 507,611,295	0.54

23	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	98,054	5,306.15 520,291,606	5,080.39 498,153,228	0.53
24	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	488,200	1,105.58 539,772,880	990.38 483,504,180	0.51
25	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・サービス	13,500	28,976.53 391,184,509	34,833.97 470,258,611	0.50
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	53,850	9,306.07 501,134,494	8,601.35 463,183,010	0.49
27	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	63,423	7,978.30 506,012,713	7,171.20 454,819,018	0.48
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	96,100	4,834.55 464,609,607	4,614.00 443,405,708	0.47
29	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	17,150	27,466.22 471,046,353	24,392.40 418,329,711	0.45
30	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	22,350	15,853.45 354,326,761	18,608.99 415,911,114	0.44

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.62%
投資証券	2.46%
合計	98.08%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.44%
素材	4.90%
資本財・サービス	10.39%
一般消費財・サービス	11.64%
生活必需品	8.58%
ヘルスケア	11.91%
金融	18.17%
情報技術	17.63%
電気通信サービス	2.38%
公益事業	3.00%
不動産	0.56%
合計	95.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2018年6月	買建	131	1,896,349,153	1,839,189,696	1.96%

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年4月	買建	6,800,000	721,624,960	721,956,000	0.77%
--------	----	-----------------	----	-----------	-------------	-------------	-------

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

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

(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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3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	117,061,819	0.79
内 アメリカ	117,061,819	0.79
投資証券	14,388,028,691	97.71
内 ガーンジー	10,458,147	0.07
内 マン島	6,778,628	0.05
内 香港	305,412,031	2.07
内 シンガポール	545,956,412	3.71
内 イスラエル	4,071,055	0.03
内 イギリス	875,578,735	5.95
内 アイルランド	40,026,413	0.27
内 オランダ	64,047,359	0.43
内 ベルギー	112,558,151	0.76
内 フランス	697,098,522	4.73
内 ドイツ	40,921,831	0.28
内 スペイン	165,074,962	1.12
内 イタリア	14,595,407	0.10
内 カナダ	280,870,744	1.91
内 アメリカ	9,988,150,024	67.83
内 オーストラリア	1,174,496,984	7.98
内 ニューージーランド	61,933,286	0.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	220,522,936	1.50
純資産総額	14,725,613,446	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	152,515,133	1.04
内 ドイツ	22,188,400	0.15
内 アメリカ	130,326,733	0.89
為替予約取引(買建)	100,532,552	0.68

内 日本	100,532,552	0.68
------	-------------	------

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

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

(注3) 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30年3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	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	39,247	16,871.54 662,158,150	16,398.14 643,577,958	4.37
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	67,146	6,960.41 467,365,163	6,692.05 449,344,900	3.05
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	19,000	22,059.56 419,132,842	21,289.43 404,499,238	2.75
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	12,640	27,961.56 353,434,410	24,231.03 306,280,320	2.08
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	17,500	19,015.04 332,764,503	17,472.23 305,764,032	2.08
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	46,400	6,960.10 322,950,477	6,546.50 303,758,008	2.06
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	25,978	12,220.14 317,455,980	11,195.57 290,838,549	1.98
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	46,700	6,969.34 325,473,146	5,782.64 270,049,437	1.83
9	LINK REIT	香港	投資証券	281,500	949.01 267,149,531	907.18 255,371,170	1.73
10	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	19,500	13,215.40 257,700,737	13,090.89 255,272,410	1.73
11	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	44,879	6,614.18 296,841,309	5,262.06 236,156,314	1.60
12	SCENTRE GROUP	オーストラ リア	投資証券	687,270	342.15 235,189,778	312.75 214,949,053	1.46
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	8,367	25,979.18 217,368,374	25,569.84 213,942,878	1.45
14	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	35,817	5,826.52 208,691,056	5,495.79 196,842,897	1.34
15	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	92,000	2,092.07 192,480,433	1,980.31 182,188,851	1.24
16	GGP INC	アメリカ	投資証券	79,577	2,464.23 196,098,471	2,173.67 172,974,169	1.17
17	WESTFIELD CORP	オーストラ リア	投資証券	247,820	691.41 171,354,353	695.74 172,419,080	1.17
18	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	12,800	13,446.79 172,119,636	13,268.31 169,834,414	1.15
19	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	21,864	8,042.79 175,849,566	7,149.95 156,326,551	1.06

20	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	15,700	9,014.35 141,526,022	9,281.12 145,713,684	0.99
21	HCP INC	アメリカ	投資証券	58,700	2,795.49 164,100,450	2,467.95 144,868,970	0.98
22	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	206,900	704.39 145,749,249	688.39 142,428,677	0.97
23	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	14,428	10,648.01 153,629,839	9,693.33 139,855,475	0.95
24	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	96,391	1,392.39 134,227,754	1,394.77 134,444,204	0.91
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	33,400	4,114.56 137,428,452	3,784.26 126,394,578	0.86
26	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	44,600	2,997.03 133,670,077	2,813.23 125,470,290	0.85
27	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	35,200	4,177.14 147,036,688	3,491.04 122,884,833	0.83
28	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	126,730	936.20 118,649,856	955.55 121,097,206	0.82
29	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	11,400	10,811.51 123,252,328	10,287.21 117,274,299	0.80
30	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	14,600	8,165.28 119,213,604	8,017.93 117,061,819	0.79

(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	0.79%
投資証券	97.71%
合計	98.50%

(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
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2018 年6月	買建	41	130,173,482	130,326,733	0.89%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2018年6月	買建	20	21,849,048	22,188,400	0.15%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2018年4月	買建	141,100	18,469,656	18,417,272	0.13%
		英ポンド買/円売 2018年4 月	買建	20,000	3,005,464	2,976,400	0.02%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2018年4月	買建	30,000	2,299,980	2,302,800	0.02%

シンガポール・ドル買/円売 2018年4月	買建	135,000	10,857,905	10,933,000	0.07%
米ドル買/円売 2018年4月	買建	450,000	47,875,440	47,789,000	0.32%
カナダ・ドル買/円売 2018年4月	買建	98,000	8,088,847	8,069,680	0.05%
豪ドル買/円売 2018年4月	買建	70,000	5,714,590	5,714,800	0.04%
香港ドル買/円売 2018年4月	買建	320,000	4,332,320	4,329,600	0.03%

(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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3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	8,479,444,225	96.44
内 タイ	689,144,480	7.84
内 マレーシア	504,772,743	5.74
内 フィリピン	20,655,250	0.23
内 インドネシア	767,976,597	8.73
内 ポーランド	716,351,199	8.15
内 ロシア	683,714,975	7.78
内 ハンガリー	379,675,980	4.32
内 ルーマニア	231,324,385	2.63
内 トルコ	569,770,247	6.48
内 チェコ	335,703,643	3.82
内 メキシコ	846,035,887	9.62
内 コロンビア	581,819,435	6.62
内 ベルギー	234,420,192	2.67
内 チリ	204,989,225	2.33
内 ブラジル	873,314,586	9.93
内 ウルグアイ	18,444,895	0.21
内 アルゼンチン	70,601,578	0.80
内 南アフリカ	750,728,928	8.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	312,563,772	3.56
純資産総額	8,792,007,997	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)	171,430,300	1.95
内 日本	171,430,300	1.95

為替予約取引(売建)		11,224,000	0.13
内 日本		11,224,000	0.13

(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30年3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	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	9,640,000	79.81 247,215,674	84.93 263,078,088	- 2020/07/01	2.99
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	12,550,000	111.72 125,911,289	115.70 130,392,743	10.500000 2026/12/21	1.48
3	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	3,810,000	99.94 122,343,271	104.38 127,785,659	10.000000 2023/01/01	1.45
4	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	21,950,000	98.14 126,026,228	98.03 125,885,576	6.500000 2021/06/10	1.43
5	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	18,350,000	116.95 125,544,504	114.81 123,246,738	10.000000 2024/12/05	1.40
6	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,350,000,000	121.37 108,384,911	120.35 107,479,694	10.000000 2024/07/24	1.22
7	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,510,000,000	106.49 101,574,573	107.76 102,781,488	7.500000 2026/08/26	1.17
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	11,520,000	91.22 94,373,156	98.86 102,275,447	8.750000 2048/02/28	1.16
9	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	3,030,000	101.48 98,801,310	104.95 102,181,679	10.000000 2021/01/01	1.16
10	Colombian TES	コロンビア	国債証券	2,535,000,000	104.70 100,867,137	105.43 101,566,498	7.000000 2022/05/04	1.16
11	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	26,600,000	107.83 97,524,922	107.31 97,057,494	3.650000 2021/12/17	1.10
12	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	2,690,000	100.46 86,828,355	103.59 89,532,526	10.000000 2025/01/01	1.02
13	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,640,000	95.10 77,960,495	96.42 79,041,501	2.500000 2026/07/25	0.90
14	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	19,050,000	122.39 79,277,177	121.15 78,469,502	4.875000 2029/06/22	0.89
15	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	9,150,000,000	108.33 77,318,393	109.61 78,228,657	8.375000 2024/03/15	0.89
16	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	2,650,000	81.77 69,623,970	88.77 75,585,326	- 2020/01/01	0.86
17	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	2,250,000	98.42 71,154,163	102.99 74,457,660	10.000000 2027/01/01	0.85
18	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	11,990,000	103.49 72,590,400	101.66 71,305,848	8.000000 2020/06/11	0.81

19	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	19,300,000	108.60 71,264,435	108.62 71,279,068	3.625000 2023/06/16	0.81
20	Russian Federal Bond - OFZ	ロシア	国債証券	36,100,000	102.32 68,339,592	105.89 70,724,647	7.750000 2026/09/16	0.80
21	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,700,000,000	107.62 69,523,865	109.38 70,661,418	7.750000 2030/09/18	0.80
22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,230,000	97.60 67,585,044	99.85 69,137,637	1.750000 2021/07/25	0.79
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	2,210,000	98.75 67,763,582	100.12 68,702,844	1.500000 2020/04/25	0.78
24	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	11,320,000	103.02 68,223,792	101.59 67,279,565	7.750000 2042/11/13	0.77
25	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	7,724,000,000	110.54 66,599,337	111.16 66,976,209	8.375000 2026/09/15	0.76
26	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	17,700,000	109.72 66,030,887	108.12 65,069,625	3.650000 2031/06/20	0.74
27	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	18,300,000	104.45 64,994,389	103.12 64,164,375	3.875000 2019/06/13	0.73
28	Russian Federal Bond - OFZ	ロシア	国債証券	31,760,000	104.77 61,562,129	108.56 63,787,863	8.150000 2027/02/03	0.73
29	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	18,200,000	102.73 63,573,317	102.46 63,405,960	2.550000 2020/06/26	0.72
30	Colombian TES	コロンビア	国債証券	1,465,000,000	115.63 64,372,334	113.00 62,910,996	11.000000 2020/07/24	0.72

(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	96.44%
合計	96.44%

(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	ルーマニア・レイ買/円売 2018年5月	買建	100,000	2,817,700	2,800,000	0.03%
		ブラジル・リアル買/円売 2018年4月	買建	700,000	22,379,854	22,491,000	0.26%
		チェコ・コルナ買/円売 2018年5月	買建	1,800,000	9,276,357	9,252,000	0.11%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2018年5月	買建	38,000,000	15,974,071	15,895,400	0.18%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年5月	買建	3,000,000	17,329,803	17,370,000	0.20%

ポーランド・ズロチ買/円売 2018年5月	買建	910,000	28,374,418	28,182,700	0.32%
ロシア・ルーブル買/円売 2018年4月	買建	7,000,000	12,931,100	12,950,000	0.15%
タイ・バーツ買/円売 2018年4月	買建	4,168,000	14,252,892	14,171,200	0.16%
トルコ・リラ買/円売 2018年4月	買建	1,200,000	32,289,600	32,280,000	0.37%
南アフリカ・ランド買/円売 2018年5月	買建	1,800,000	16,104,809	16,038,000	0.18%
ルーマニア・レイ売/円買 2018年4月	売建	400,000	11,212,000	11,224,000	0.13%

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年3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	161,125,745,003	98.46
内 ユーロ	67,707,959,364	41.37
内 シンガポール	640,207,835	0.39
内 マレーシア	782,798,855	0.48
内 ノルウェー	470,832,073	0.29
内 スウェーデン	623,886,893	0.38
内 デンマーク	948,382,849	0.58
内 イギリス	11,648,534,619	7.12
内 スイス	273,290,669	0.17
内 ポーランド	1,087,698,643	0.66
内 カナダ	3,325,605,596	2.03
内 アメリカ	67,849,811,533	41.46
内 メキシコ	1,284,201,602	0.78
内 南アフリカ	1,076,307,597	0.66
内 オーストラリア	3,406,226,875	2.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,527,334,406	1.54
純資産総額	163,653,079,409	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,411,179,540	0.86
内 日本	1,411,179,540	0.86

(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30年3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	6,287,000	99.30 663,295,618	97.64 652,167,711	2.000000 2022/11/30	0.40
2	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,807,000	165.97 608,063,691	165.06 604,755,373	5.750000 2032/10/25	0.37
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	98.80 619,319,280	95.93 601,348,465	2.250000 2027/08/15	0.37
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	99.47 617,190,486	96.82 600,761,192	2.250000 2025/11/15	0.37
5	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,697,000	125.56 605,867,731	123.43 595,613,917	4.250000 2023/10/25	0.36
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	98.87 607,999,302	96.32 592,337,363	2.125000 2025/05/15	0.36
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,029,000	94.47 605,138,582	92.02 589,426,603	1.625000 2026/05/15	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	99.92 605,138,046	97.10 588,012,583	2.375000 2027/05/15	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	98.14 598,787,784	95.70 583,918,762	2.000000 2025/02/15	0.36
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,734,000	161.91 577,794,479	163.06 581,883,885	4.500000 2041/04/25	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	97.81 596,786,537	95.32 581,581,940	2.000000 2025/08/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.55 570,018,927	95.83 559,983,072	2.250000 2027/11/15	0.34
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,229,000	103.05 572,494,814	100.67 559,256,559	2.750000 2024/02/15	0.34
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,824,000	149.31 550,357,888	149.94 552,683,682	4.000000 2038/10/25	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	97.03 567,018,284	94.37 551,452,000	2.000000 2026/11/15	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,499,000	120.81 551,763,095	119.95 547,830,999	2.750000 2027/10/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	93.28 554,969,712	90.82 540,375,736	1.500000 2026/08/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,162,000	100.73 552,436,215	98.29 539,065,958	2.375000 2024/08/15	0.33
19	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	2,849,000	144.60 537,712,114	144.59 537,671,210	6.000000 2031/05/01	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,021,000	103.16 550,308,798	100.70 537,181,060	2.750000 2023/11/15	0.33
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,630,000	114.53 542,657,365	113.00 535,413,153	3.000000 2022/04/25	0.33

22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,366,000	94.68 539,795,285	92.30 526,210,187	1.625000 2026/02/15	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,550,000	114.21 529,206,000	112.57 521,625,659	3.250000 2021/10/25	0.32
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	152.28 521,346,880	150.64 515,752,817	5.500000 2029/04/25	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	126.42 519,137,601	124.75 512,247,466	3.500000 2026/04/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	99.49 486,242,950	100.07 489,085,189	2.750000 2028/02/15	0.30
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,399,000	111.21 493,390,150	110.03 488,156,501	1.750000 2024/11/25	0.30
28	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,086,000	151.93 471,712,628	157.16 487,950,745	4.250000 2046/12/07	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	102.19 489,531,842	100.64 482,121,152	2.625000 2020/11/15	0.29
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.96 487,580,618	96.06 478,133,619	1.750000 2023/05/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.46%
合計	98.46%

(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 2018年4月	買建	516,000	42,811,516	42,121,080	0.03%
		カナダ・ドル買/円売 2018年4月	買建	463,000	38,475,274	38,132,680	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2018年5月	買建	74,000	6,109,884	6,085,020	0.00%
		ユーロ買/円売 2018年5月	買建	784,000	103,063,046	102,366,880	0.06%
		ユーロ買/円売 2018年4月	買建	4,271,000	559,980,218	557,450,920	0.34%
		英ポンド買/円売 2018年4 月	買建	214,000	32,115,616	31,847,480	0.02%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2018年4月	買建	1,891,000	17,059,853	16,962,270	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2018年4月	買建	2,092,000	11,974,920	12,217,280	0.01%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2018年5月	買建	206,000	6,427,509	6,377,760	0.00%

スウェーデン・クローネ 買/円売 2018年4月	買建	695,000	8,975,369	8,819,550	0.01%
米ドル買/円売 2018年5月	買建	958,000	102,049,714	101,528,840	0.06%
米ドル買/円売 2018年4月	買建	4,451,000	471,370,723	472,696,200	0.29%
英ポンド買/円売 2018年5 月	買建	98,000	14,715,797	14,573,580	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

●iFree 8資産バランス

2018年3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	11,370円
純資産総額	69億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.1%
3カ月間	-3.6%
6カ月間	-0.2%
1年間	4.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	13.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期								
	17年9月								
分配金	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

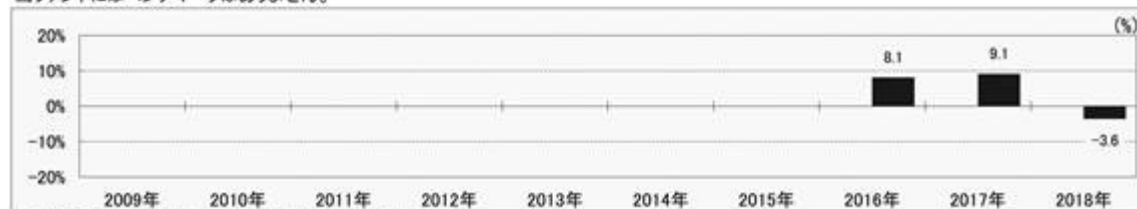
※比率は、純資産総額に対するものです。

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
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.6%	外国債券	909	24.2%	日本円	38.3%	日本ビルファンド	日本	0.9%
トビックス・インデックス・MF	12.5%	外国株式・先物	1,608	23.6%	米ドル	23.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.4%	外国リート・先物	327	12.7%	ユーロ	7.8%	野村不動産マスターF	日本	0.7%
ダイワJ-REIT MF	12.4%	国内株式・先物	1,498	12.5%	香港ドル	3.8%	日本リートファンド	日本	0.6%
外国債券INDEXMF	12.4%	国内リート・先物	61	12.3%	ブラジル・リアル	2.9%	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.6%
外国株式INDEXMF	12.3%	国内債券	272	12.2%	英ポンド	2.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.6%
日本債券インデックスMF(BPI)	12.3%	外国投資信託等	8	0.5%	南アフリカ・ランド	2.0%	オリックス不動産投資	日本	0.5%
ダイワ新興国株式 F-INDEXT-MF	12.2%				メキシコ・ペソ	1.8%	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	0.5%
					台湾ドル	1.8%	日本プロロジリート	日本	0.5%
		コール・ローン、その他		3.0%	その他	15.3%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.5%
合計	99.0%	合計	4,683	-	合計	100.0%	合計		6.0%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月8日)から年末、2018年は3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 【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30年3月30日

資産総額	6,956,958,511円
負債総額	7,123,438円
純資産総額（ - ）	6,949,835,073円
発行済数量	6,112,484,440口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1370円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	146,469,752,463円
負債総額	5,530,927,451円
純資産総額（ - ）	140,938,825,012円
発行済数量	130,807,458,139口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0775円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	212,818,857,537円
負債総額	620,614,243円
純資産総額（ - ）	212,198,243,294円
発行済数量	87,346,103,587口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.4294円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	15,433,588,281円
負債総額	40,457,120円

純資産総額（ - ）	15,393,131,161円
発行済数量	12,080,679,468口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2742円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	5,096,704,130円
負債総額	31,274,681円
純資産総額（ - ）	5,065,429,449円
発行済数量	3,128,667,990口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6190円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	94,014,090,805円
負債総額	83,459,198円
純資産総額（ - ）	93,930,631,607円
発行済数量	41,225,783,447口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2784円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	14,791,808,317円
負債総額	66,194,871円
純資産総額（ - ）	14,725,613,446円
発行済数量	7,316,570,459口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0126円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	8,985,174,354円
負債総額	193,166,357円
純資産総額（ - ）	8,792,007,997円
発行済数量	6,253,173,985口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4060円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成30年3月30日

資産総額	166,603,935,395円
負債総額	2,950,855,986円
純資産総額（ - ）	163,653,079,409円
発行済数量	60,182,021,443口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.7193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

2018年3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。

2018年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	194,879
追加型株式投資信託	701	14,968,640
株式投資信託 合計	782	15,163,519
単位型公社債投資信託	24	102,614
追加型公社債投資信託	14	1,465,034
公社債投資信託 合計	38	1,567,648
総合計	820	16,731,166

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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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。）。

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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>

「iFreeのポイント」を記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30年4月6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iFree 8資産バランスの平成29年9月8日から平成30年3月7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、iFree 8資産バランスの平成30年3月7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9月8日から平成30年3月7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。