

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年6月5日提出
【計算期間】	第4計算期間中 （自 2019年9月14日 至 2020年3月13日）
【ファンド名】	ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック （年1回） - （為替ヘッジあり）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	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】

(1) 【投資状況】（2020年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	2,332,402,546	99.00
内 日本	2,332,402,546	99.00
親投資信託受益証券	3,990	0.00
内 日本	3,990	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	23,565,218	1.00
純資産総額	2,355,971,754	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 (2017年9月13日)	3,744,839,954	3,744,839,954	1.2430	1.2430
第2計算期間末 (2018年9月13日)	4,605,888,274	4,605,888,274	1.3401	1.3401
2019年3月末日	3,861,771,010	-	1.2937	-
4月末日	3,987,406,655	-	1.3988	-
5月末日	3,406,769,905	-	1.2468	-
6月末日	3,794,341,591	-	1.3407	-
7月末日	3,725,741,499	-	1.3541	-
8月末日	3,527,132,031	-	1.2855	-
第3計算期間末 (2019年9月13日)	3,714,205,844	3,714,205,844	1.3570	1.3570
9月末日	3,518,173,935	-	1.3196	-
10月末日	3,585,564,038	-	1.3675	-
11月末日	3,646,679,047	-	1.4486	-
12月末日	3,376,573,092	-	1.4924	-
2020年1月末日	3,046,540,238	-	1.4789	-
2月末日	2,606,204,103	-	1.3550	-
3月末日	2,355,971,754	-	1.2397	-

【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
2019年9月14日～ 2020年3月13日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	24.3
第2計算期間	7.8
第3計算期間	1.3
2019年9月14日～ 2020年3月13日	16.6

（参考）投資信託証券

アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

（１）投資状況

（2020年3月末日現在）

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	12,260,789,177	96.15
内 日本	12,260,789,177	96.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	490,977,115	3.85
純資産総額	12,751,766,292	100.00

その他の資産の投資状況

（2020年3月末日現在）

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引（売建）	9,583,348,000	75.15
内 日本	9,583,348,000	75.15

参考情報 アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド

投資状況

（2020年3月末日現在）

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	206,902,581,372	96.43
内 アメリカ	132,441,094,819	61.72
内 日本	34,326,821,500	16.00
内 ドイツ	14,498,749,938	6.76
内 オランダ	6,136,168,940	2.86
内 台湾	5,038,825,275	2.35
内 イギリス	2,945,897,604	1.37
内 フランス	2,740,125,033	1.28
内 カナダ	2,407,077,725	1.12
内 ケイマン諸島	2,347,299,430	1.09
内 アイスランド	2,288,785,552	1.07
内 ジャージー	1,731,735,556	0.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,664,733,441	3.57
純資産総額	214,567,314,813	100.00

その他資産の投資状況

（2020年3月末日現在）

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	10,007,357	0.00
内 日本	10,007,357	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）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

（1）投資状況（2020年3月31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）	76,809,622,184	100.00
純資産総額	76,809,622,184	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

● ロボット・テクノロジー関連株ファンド(年1回決算型) ―ロボテック(年1回)―(為替ヘッジあり)

2020年3月31日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,397円
純資産総額	23億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-8.5%
3カ月間	-16.9%
6カ月間	-6.1%
1年間	-4.2%
3年間	11.8%
5年間	-
設定来	24.0%



※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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円			設定来分配金合計額: 0円						
	第1期 17年9月	第2期 18年9月	第3期 19年9月							
分配金	0円	0円	0円							

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

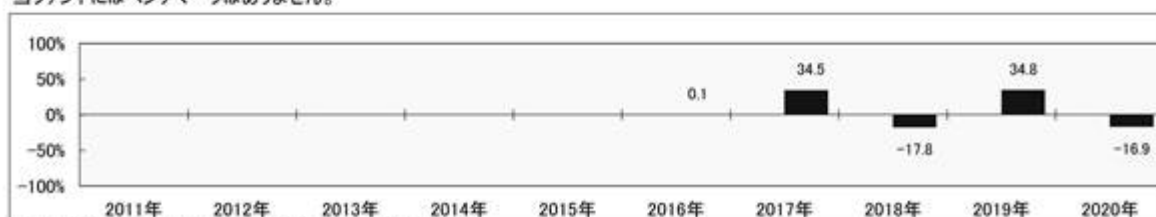
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
アクサ・インベストメント・マネージャーズ	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	99.0%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネースtock・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。

・2016年は設定日(9月30日)から年末、2020年は3月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

*「大和証券投資信託委託」は4月1日付で「大和アセットマネジメント」に社名変更しておりますが、上記は作成時点の社名で記載しております。

2 【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	4,129,777,078	1,118,142,677
第2計算期間	2,344,444,160	1,919,980,639
第3計算期間	417,755,657	1,117,854,758
2019年9月14日 ~ 2020年3月13日	93,384,644	924,768,966

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

3 【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年9月14日から2020年3月13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。

ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） - （為替ヘッジあり）

(1) 【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2019年9月13日現在	当中間計算期間末 2020年3月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,472,561	72,113,518
投資信託受益証券	3,695,407,231	2,137,188,466
親投資信託受益証券	3,991	3,990
未収入金	10,000,000	-
流動資産合計	3,758,883,783	2,209,305,974
資産合計	3,758,883,783	2,209,305,974
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,681,143	30,890,646
未払受託者報酬	507,545	456,516
未払委託者報酬	22,334,193	20,088,754
その他未払費用	155,058	137,141
流動負債合計	44,677,939	51,573,057
負債合計	44,677,939	51,573,057
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,736,998,821	1 1,905,614,499
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	977,207,023	252,118,418
（分配準備積立金）	313,736,480	209,599,196
元本等合計	3,714,205,844	2,157,732,917
純資産合計	3,714,205,844	2,157,732,917
負債純資産合計	3,758,883,783	2,209,305,974

(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9月14日 至 2019年3月13日	当中間計算期間 自 2019年9月14日 至 2020年3月13日
営業収益		
受取利息	21	158
有価証券売買等損益	168,620,619	328,218,766
営業収益合計	168,620,598	328,218,608
営業費用		
支払利息	14,012	14,542
受託者報酬	551,105	456,516
委託者報酬	24,250,375	20,088,754
その他費用	179,385	137,528
営業費用合計	24,994,877	20,697,340
営業損失（ ）	193,615,475	348,915,948
経常損失（ ）	193,615,475	348,915,948
中間純損失（ ）	193,615,475	348,915,948
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（ ）	39,282,605	84,031,939
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,168,790,352	977,207,023
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,761,692	38,697,318
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,761,692	38,697,318
剰余金減少額又は欠損金増加額	201,752,851	330,838,036
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	201,752,851	330,838,036
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	857,466,323	252,118,418

(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9月14日 至 2020年3月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2019年9月13日現在	当中間計算期間末 2020年3月13日現在

1.	1 期首元本額	3,437,097,922円	2,736,998,821円
	期中追加設定元本額	417,755,657円	93,384,644円
	期中一部解約元本額	1,117,854,758円	924,768,966円
2.	中間計算期間末日における 受益権の総数	2,736,998,821口	1,905,614,499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9月14日 至 2019年3月13日	自 2019年9月14日 至 2020年3月13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 2020年3月13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9月13日現在	当中間計算期間末 2020年3月13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9月13日現在	当中間計算期間末 2020年3月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3570円 (13,570円)	1.1323円 (11,323円)

（参考）

当ファンドは、「アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）」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「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・マネースtock・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。

「アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ファンドの経理状況

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「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）及び同規則第2条の2の規定による「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）並びに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作成しております。
- なお、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) 当ファンドの計算期間は6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、第6期計算期間（2019年2月14日から2019年8月13日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。
- その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

財務諸表

アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

（単位：円）

	第5期 (2019年2月13日現在)	第6期 (2019年8月13日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	371,141,116	329,588,726
親投資信託受益証券	22,712,059,911	17,525,710,385
派生商品評価勘定	826,252	374,459,654
未収入金	322,390	15,931,290
流動資産合計	23,084,349,669	18,245,690,055
資産合計	23,084,349,669	18,245,690,055
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	166,516,640	-
未払受託者報酬	2,527,993	2,241,023
未払委託者報酬	63,832,829	56,586,975
その他未払費用	599,635	593,651
流動負債合計	233,477,097	59,421,649
負債合計	233,477,097	59,421,649
純資産の部		
元本等		
元本	17,611,215,424	13,864,844,287
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,239,657,148	4,321,424,119
（ 分配準備積立金 ）	3,360,639,813	2,695,450,377
元本等合計	22,850,872,572	18,186,268,406
純資産合計	22,850,872,572	18,186,268,406
負債純資産合計	23,084,349,669	18,245,690,055

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第5期 （自 2018年8月14日 至 2019年2月13日）	第6期 （自 2019年2月14日 至 2019年8月13日）
営業収益		
有価証券売買等損益	952,090,288	16,349,526
派生商品取引等損益	5,629,473	11,750,175
為替差損益	338,079,690	569,480,974
営業収益合計	1,284,540,505	564,881,623
営業費用		
支払利息	25,940	47,684
受託者報酬	2,527,993	2,241,023
委託者報酬	63,832,829	56,586,975
その他費用	623,758	610,163
営業費用合計	67,010,520	59,485,845
営業利益又は営業損失（ ）	1,351,551,025	505,395,778
経常利益又は経常損失（ ）	1,351,551,025	505,395,778
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,351,551,025	505,395,778
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	147,244,753	316,878,031
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,071,874,869	5,239,657,148
剰余金増加額又は欠損金減少額	83,436,590	59,078,723

当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	83,436,590	59,078,723
剰余金減少額又は欠損金増加額	711,348,039	1,165,829,499
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	711,348,039	1,165,829,499
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,239,657,148	4,321,424,119

（３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法による時価で評価しております。 なお、時価は、親投資信託受益証券の基準価額を用いております。
２．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価に当たっては、原則として計算期間末日において、為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該仲値、仲値が発表されていない場合には、発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。 直物為替先渡取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては価格情報会社の提供する価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		第5期 (2019年2月13日現在)	第6期 (2019年8月13日現在)
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	19,120,548,694円	17,611,215,424円
	期中追加設定元本額	416,563,416円	170,921,280円
	期中一部解約元本額	1,925,896,686円	3,917,292,417円
2.	受益権の総数	17,611,215,424口	13,864,844,287口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期 (自 2018年8月14日 至 2019年2月13日)		第6期 (自 2019年2月14日 至 2019年8月13日)	
1. 分配金の計算過程		1. 分配金の計算過程	
費用控除後の配当等収益額	35,295,999円	費用控除後の配当等収益額	81,249,654円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円
収益調整金額	1,879,017,335円	収益調整金額	2,482,977,135円
分配準備積立金額	3,325,343,814円	分配準備積立金額	2,614,200,723円
当ファンドの分配対象収益額	5,239,657,148円	当ファンドの分配対象収益額	5,178,427,512円

当ファンドの期末残存口数 17,611,215,424口	当ファンドの期末残存口数 13,864,844,287口
1万口当たり収益分配対象額 2,975.18円	1万口当たり収益分配対象額 3,734.93円
1万口当たり分配金額 - 円	1万口当たり分配金額 - 円
収益分配金金額 - 円	収益分配金金額 - 円
2．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額より、運用権限委託契約に定められた報酬額を支払っております。	2．信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2018年8月14日 至 2019年2月13日	第6期 自 2019年2月14日 至 2019年8月13日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する主な金融資産は親投資信託受益証券であり、売買目的で保有しております。 デリバティブ取引には、通貨関連では為替予約取引および直物為替先渡取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。 投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク&コントロール部門を設置し、全社的なリスク管理活動およびガイドラインのモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第5期	第6期
	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在

1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額は ありません。	同左
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------------	--	-----------

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第5期 （2019年2月13日現在）	第6期 （2019年8月13日現在）
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
親投資信託受益証券	881,419,227	356,641,557
合計	881,419,227	356,641,557

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

種類	第5期 (2019年2月13日 現在)				第6期 (2019年8月13日 現在)			
	契約額等	うち 1 年 超	時価	評価損益	契約額等	うち 1 年 超	時価	評価損益
市場取引 以外の取引								
為替予約 取引(注1)								
売 建	17,990,531,064	-	18,156,306,160	165,775,096	15,364,432,725	-	14,995,256,150	369,176,575
アメリカ・ ドル	15,381,597,420	-	15,538,302,400	156,704,980	13,126,505,700	-	12,809,581,400	316,924,300
イギリス・ ポンド	176,728,944	-	176,018,760	710,184	211,208,625	-	200,418,750	10,789,875
ユーロ	2,432,204,700	-	2,441,985,000	9,780,300	2,026,718,400	-	1,985,256,000	41,462,400
合計	17,990,531,064	-	18,156,306,160	165,775,096	15,364,432,725	-	14,995,256,150	369,176,575

(単位 : 円)

種類	第5期 (2019年2月13日 現在)				第6期 (2019年8月13日 現在)			
	契約額等	うち 1 年 超	時価	評価損益	契約額等	うち 1 年 超	時価	評価損益
市場取引以外の取引								
直物為替先渡取引(注2)								
売 建	416,002,624	-	415,917,916	84,708	440,775,201	-	435,890,725	5,283,079
台湾・ドル	416,002,624	-	415,917,916	84,708	440,775,201	-	435,890,725	5,283,079
合計	416,002,624	-	415,917,916	84,708	440,775,201	-	435,890,725	5,283,079

(注1) 1. 時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下、「当該日」とする。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（注 2） 1．時価の算定方法

1) 価格情報会社が計算日の対顧客相場の仲値を基準として計算し、提供する価額により評価しております。

2) 直物為替先渡取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3) 直物為替先渡取引の残高は、対米ドルの取引残高を邦貨換算して表示しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第5期 (2019年2月13日現在)	第6期 (2019年8月13日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2975円 (12,975円)	1.3117円 (13,117円)

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（４）附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド	15,711,080,579	17,525,710,385	
親投資信託受益証券 合計		15,711,080,579	17,525,710,385	
合計		15,711,080,579	17,525,710,385	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

参考情報

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。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の状況は以下の通りです。

「アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,873,955,950	904,385,650
金銭信託	507,749	86,580
コール・ローン	2,122,808,020	2,870,197,375
株式	379,770,656,460	294,184,257,240
未収入金	-	1,638,895,935
未収配当金	147,208,154	126,585,623
流動資産合計	386,915,136,333	299,724,408,403
資産合計	386,915,136,333	299,724,408,403
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	54,289	-
未払金	963,573,955	527,143,398
未払解約金	600,000,000	800,000,000
その他未払費用	142,124	114,543
流動負債合計	1,563,770,368	1,327,257,941
負債合計	1,563,770,368	1,327,257,941
純資産の部		
元本等		
元本	338,565,889,925	267,501,155,254
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）	46,785,476,040	30,895,995,208
元本等合計	385,351,365,965	298,397,150,462
純資産合計	385,351,365,965	298,397,150,462
負債純資産合計	386,915,136,333	299,724,408,403

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	組入有価証券（株式）については移動平均法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。
--------------------	---

金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合は、当該金融商品取引所等における直近の最終相場もしくは当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。

金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

時価が入手できなかった有価証券

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、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ等の 評価基準及び評価 方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、原則として計算期間末日において、為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は当該仲値、仲値が発表されていない場合には、発表されている先物相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。ただし、同第61条に基づき外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定および外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産総額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。
----------------------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
１．投資信託財産に係る元本の状況 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 元本の内訳 ファンド名 アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし） （適格機関投資家専用）	368,413,075,965円 2,302,420,788円 32,149,606,828円 318,611,523,459円	338,565,889,925円 - 円 71,064,734,671円 251,790,074,675円

	アクサ IM・グローバル・ロボット関 連株式ファンド（為替ヘッジあり） （適格機関投資家専用） 計	19,954,366,466円 338,565,889,925円	15,711,080,579円 267,501,155,254円
2 .	受益権の総数	338,565,889,925口	267,501,155,254口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年8月14日 至 2019年2月13日	自 2019年2月14日 至 2019年8月13日
1 . 金融商品に対する取組 方針	当該親投資信託は、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当該親投資信託が保有する主な金融資産は株式であり、売買目的で保有しております。 デリバティブ取引には、通貨関連では為替予約取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。 投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	当該親投資信託に投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

2．時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 該当はありません。 (3) 上記以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等はいくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価 差額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
株式	14,777,694,469	6,851,332,252
合計	14,777,694,469	6,851,332,252

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

種類	2019年2月13日 現在				2019年8月13日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
		うち 1年 超				うち 1年 超		
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売 建	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-
合計	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-

（注）１．時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下、「当該日」とする。）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

２．換算において円未満の端数は切り捨てております。

３．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
1口当たり純資産額	1.1382円	1.1155円
（1万口当たり純資産額）	(11,382円)	(11,155円)

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	ナブテスコ	1,170,400	2,941.000	3,442,146,400	
	S M C	147,500	39,060.000	5,761,350,000	
	ダイフク	772,800	4,800.000	3,709,440,000	
	安川電機	1,276,900	3,305.000	4,220,154,500	
	日本電産	368,200	13,705.000	5,046,181,000	
	オムロン	873,400	5,050.000	4,410,670,000	
	キーエンス	166,500	60,340.000	10,046,610,000	
	ファナック	359,000	17,825.000	6,399,175,000	
	ミスミグループ本社	1,765,900	2,323.000	4,102,185,700	

日本円 小計		6,900,600		47,137,912,600	
アメリカ・ドル	NXP SEMICONDUCTORS NV	368,151	98.250	36,170,835.75	
	WRIGHT MEDICAL GROUP NV	1,518,396	20.770	31,537,084.92	
	ABIOMED INC	75,637	191.720	14,501,125.64	
	ACCELERATE DIAGNOSTICS INC	940,253	17.260	16,228,766.78	
	ADVANCED MICRO DEVICES	832,310	32.430	26,991,813.30	
	APTIV PLC	412,126	82.560	34,025,122.56	
	TE CONNECTIVITY LTD	523,270	88.170	46,136,715.90	
	ALPHABET INC-CL C	87,876	1,174.710	103,228,815.96	
	AMAZON.COM INC.	48,398	1,784.920	86,386,558.16	
	ANALOG DEVICES	278,610	108.960	30,357,345.60	
	ANSYS INC	273,613	207.040	56,648,835.52	
	APPLE INC.	299,279	200.480	59,999,453.92	
	ASPEN TECHNOLOGY INC	312,683	136.300	42,618,692.90	
	AUTODESK INC	422,418	148.870	62,885,367.66	

BECTON DICKINSON & CO	164,601	249.160	41,011,985.16	
BLACKBERRY LTD	3,021,655	6.840	20,668,120.20	
CADENCE DESIGN SYS INC	998,939	68.720	68,647,088.08	
CISCO SYSTEMS	1,050,997	51.540	54,168,385.38	
COGNEX CORP	1,247,875	43.010	53,671,103.75	
DEXCOM INC	388,719	151.930	59,058,077.67	
GLOBUS MEDICAL INC-A	521,074	48.670	25,360,671.58	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	334,454	164.960	55,171,531.84	
IPG PHOTONICS CORP	271,580	118.620	32,214,819.60	
ILLUMINA INC	158,991	290.340	46,161,446.94	
INTUITIVE SURGICAL INC	170,973	509.880	87,175,713.24	
LUMENTUM HOLDINGS INC	665,342	57.570	38,303,738.94	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	521,228	87.300	45,503,204.40	
NOVANTA INC	381,556	71.090	27,124,816.04	
NVIDIA CORP	194,556	151.450	29,465,506.20	

	NUVASIVE INC	454,105	65.360	29,680,302.80	
	PTC INC	1,087,745	64.650	70,322,714.25	
	PARKER HANNIFIN CORP	166,270	161.500	26,852,605.00	
	QUALCOMM INC	1,186,217	69.800	82,797,946.60	
	SILICON LABORATORIES INC	556,886	103.830	57,821,473.38	
	TERADYNE INC	1,511,537	52.250	78,977,808.25	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	532,848	120.080	63,984,387.84	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	285,313	272.000	77,605,136.00	
	TRIMBLE INC	1,611,036	37.210	59,946,649.56	
	XILINX INC	351,912	103.180	36,310,280.16	
	AMBARELLA INC	639,103	44.580	28,491,211.74	
アメリカ・ドル 小計		24,868,532		1,944,213,259.170 (204,978,403,914)	
イギリス・ ポンド	OCADO GROUP PLC	2,204,410	11.925	26,287,589.250	
イギリス・ポンド 小計		2,204,410		26,287,589.250 (3,347,198,739)	
ユーロ	CONTINENTAL AG	177,849	110.980	19,737,682.020	

	SCHNEIDER ELECTRIC SE	450,689	73.060	32,927,338.340	
	DUERR AG	838,245	22.830	19,137,133.350	
	SIEMENS AG	601,048	88.620	53,264,873.760	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,710,735	16.060	43,534,404.100	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,267,018	41.455	52,524,231.190	
	KION GROUP AG	791,388	42.790	33,863,492.520	
	MAREL HF	4,100,504	4.210	17,263,121.840	
ユーロ 小計		10,937,476		272,252,277.120 (32,172,051,587)	
台湾・ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,765,000	251.000	1,949,015,000.000	
台湾・ドル 小計		7,765,000		1,949,015,000.000 (6,548,690,400)	
合計		52,676,018		294,184,257,240 (247,046,344,640)	

有価証券明細表注記

- 1.各種通貨ごとの小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 2.合計欄の（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 3.外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 40銘柄	100%	82.97%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	100%	1.36%
ユーロ	株式 8銘柄	100%	13.02%
台湾・ドル	株式 1銘柄	100%	2.65%

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・マネースtock・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9月13日現在	2020年3月13日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,298,074,038	86,311,084,265
流動資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265
資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,000,000,000	1,640,000,000
その他未払費用	61,004	-
流動負債合計	8,000,061,004	1,640,000,000
負債合計	8,000,061,004	1,640,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	95,143,024,361	84,552,982,137
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	154,988,673	118,102,128
元本等合計	95,298,013,034	84,671,084,265
純資産合計	95,298,013,034	84,671,084,265

負債純資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265
---------	-----------------	----------------

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

自 2019年9月14日 至 2020年3月13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9月13日現在	2020年3月13日現在
1. 1 期首	2018年9月14日	2019年9月14日
期首元本額	40,620,506,061円	95,143,024,361円
期中追加設定元本額	194,472,971,255円	51,004,873,930円
期中一部解約元本額	139,950,452,955円	61,594,916,154円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ米国バンクローン・ ファンド（為替ヘッジあり） 2014-11	9,962円	- 円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド - ロボテック -	947,268円	947,268円

ダイワノミレーアセット・インド株式ファンド - インドの匠 -	29,910,270円	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジあり）	998円	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジなし）	998円	998円
新興国ソブリン・豪ドルファンド（毎月決算型）	999円	999円
新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド（毎月決算型）	999円	999円
新興国ソブリン・ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	999円	999円
U S 短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	102,434円	102,434円
U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	1,994円	- 円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック -（為替ヘッジあり）	39,849円	39,849円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） -（為替ヘッジあり）	3,985円	3,985円
iFreeレバレッジ S&P500	995,814円	350,506,500円

iFreeレバレッジ NASDAQ100	29,943,109円	1,318,120,693円
米国4資産リスク分散ファン ド（年2回決算型）	- 円	695,894円
ダイワ上場投信 - 日経平均レ バレッジ・インデックス	4,911,565,673円	3,576,746,324円
ダイワ上場投信 - 日経平均ダ ブルインバース・インデック ス	4,536,789,944円	6,283,864,801円
ダイワ上場投信 - TOPIXレバ レッジ（2倍）指数	875,293,071円	695,513,811円
ダイワ上場投信 - TOPIXダブ ルインバース（-2倍）指数	1,076,577,900円	1,715,662,215円
ダイワ上場投信 - 日経平均イ ンバース・インデックス	46,620,451,844円	18,661,491,538円
ダイワ上場投信 - TOPIXイン バース（-1倍）指数	9,472,774,219円	8,174,312,515円
ダイワ上場投信 - J P X 日経 400レバレッジ・インデック ス	303,574,325円	223,670,219円
ダイワ上場投信 - J P X 日経 400インバース・インデック ス	811,328,174円	1,210,749,016円
ダイワ上場投信 - J P X 日経 400ダブルインバース・イン デックス	511,559,859円	266,923,314円
ダイワ米国投資法人債ファン ド（為替ヘッジあり）2016- 07	997円	997円

ダイワ米国投資法人債ファン ド（部分為替ヘッジあり） 2016-07	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド（為替ヘッジあり）2017- 06	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド（部分為替ヘッジあり） 2017-06	997円	- 円
ダイワ米国投資法人債ファン ド（為替ヘッジあり）2016- 10	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド（部分為替ヘッジあり） 2016-10	997円	- 円
先進国トータルリターン戦略 ファンド（リスク抑制型／適 格機関投資家専用）	4,492,163,684円	6,988,339,549円
ダイワ日本株式ベア・ファン ド（適格機関投資家専用）	6,922,448,226円	20,672,106,377円
低リスク型アロケーション ファンド（金利トレンド判断 付き／適格機関投資家専用）	179,433,743円	179,433,743円
ダイワ日本国債15-20年ラ ダー型ファンド・マネーポー トフォリオ - SLトレード -	186,025,234円	108,270,087円

ダイワノモルガン・スタン レー新興4カ国不動産関連 ファンド - 成長の槌音（つち おと） -	5,020,480円	- 円
ダイワノハリス世界厳選株 ファンド・マネー・ポート フォリオ	169,844,029円	91,246,524円
ダイワ・アセアン内需関連株 ファンド・マネー・ポート フォリオ	10,164,639円	8,372,185円
低リスク型アロケーション ファンド（適格機関投資家専 用）	13,958,125,625円	13,958,125,625円
通貨選択型ダイワノミレーア セット・グローバル・グレー トコンシューマー株式ファン ド 豪ドル・コース（毎月 分配型）	595,106円	595,106円
通貨選択型ダイワノミレーア セット・グローバル・グレー トコンシューマー株式ファン ド ブラジル・リアル・ コース（毎月分配型）	987,373円	987,373円
通貨選択型ダイワノミレーア セット・グローバル・グレー トコンシューマー株式ファン ド 通貨セレクト・コース （毎月分配型）	494,581円	494,581円

ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	9,957円	9,957円
ダイワ米国バンクロン・オープン（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ米国バンクロン・オープン（為替ヘッジなし）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）	997円	997円
ダイワ／ミレーアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円	9,958,176円
< 奇数月定額払出型 > ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり	49,806円	- 円
< 奇数月定額払出型 > ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし	49,806円	- 円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース	1,989,053円	1,989,053円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース	2,978,118円	2,978,118円

通貨選択型ダイワノミレーア セット・グローバル好配当株 α（毎月分配型）通貨セレクト・コース	1,691,241円	1,691,241円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） -	100,588円	100,588円
ダイワ先進国リートα 為替 ヘッジあり（毎月分配型）	399,083円	399,083円
ダイワ先進国リートα 為替 ヘッジなし（毎月分配型）	99,771円	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リー トα 円ヘッジコース（毎月 分配型）	399,083円	399,083円
通貨選択型ダイワ先進国リー トα 通貨セレクトコース （毎月分配型）	99,771円	99,771円
ダイワノミレーアセット・グ ローバル・グレートコン シューマー株式ファンド（為 替ヘッジあり）	1,091,429円	1,091,429円
ダイワノミレーアセット・グ ローバル・グレートコン シューマー株式ファンド（為 替ヘッジなし）	315,004円	315,004円
ダイワノミレーアセット・ア ジア・セクターリーダー株 ファンド	10,009,811円	10,009,811円

ダイワ日本株ストラテジー α （通貨選択型） - ジャパ ン・トリプルリターンズ - 日本円・コース（毎月分配 型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジー α （通貨選択型） - ジャパ ン・トリプルリターンズ - 豪ドル・コース（毎月分配 型）	99,691円	99,691円
ダイワ日本株ストラテジー α （通貨選択型） - ジャパ ン・トリプルリターンズ - ブラジル・リアル・コース （毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジー α （通貨選択型） - ジャパ ン・トリプルリターンズ - 米ドル・コース（毎月分配 型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジー α （通貨選択型） - ジャパ ン・トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース（毎月 分配型）	1,993,820円	1,993,820円

	通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 日本 円・コース	300,273円	300,273円
	通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 豪ド ル・コース	200,861円	200,861円
	通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 ブラジ ル・リアル・コース	300,273円	300,273円
	通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 米ド ル・コース	1,999,177円	1,999,177円
	通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 通貨セ レクト・コース	505,900円	505,900円
	計	95,143,024,361円	84,552,982,137円
2.	期末日における受益権の総数	95,143,024,361口	84,552,982,137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	2020年3月13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9月13日現在	2020年3月13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9月13日現在	2020年3月13日現在
1口当たり純資産額	1.0016円	1.0014円
（1万口当たり純資産額）	(10,016円)	(10,014円)

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2020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年間ににお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。

2020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	54	87,678
追加型株式投資信託	694	14,373,314
株式投資信託 合計	748	14,460,993
単位型公社債投資信託	27	100,159
追加型公社債投資信託	14	1,421,970
公社債投資信託 合計	41	1,522,128
総合計	789	15,983,121

(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2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 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。

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60期事業年度（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。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019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 (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	1 213	1 206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836

出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

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

利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725

福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

（単位：百万円）

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

十期報告書（内閣投資信託）

	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 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

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

証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

（１）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (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)
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 (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)
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 (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)
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㈱	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	㈱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㈱	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 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いません。

(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。

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 （2019年９月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	19,529
有価証券	724
未収委託者報酬	11,175
その他	383
流動資産合計	31,812
固定資産	
有形固定資産	1 211
無形固定資産	
ソフトウェア	2,380
その他	403
無形固定資産合計	2,784
投資その他の資産	
投資有価証券	7,928
関係会社株式	2,664
繰延税金資産	1,205
その他	1,280
投資その他の資産合計	13,078
固定資産合計	16,073
資産合計	47,886

（単位：百万円）

当中間会計期間
（2019年9月30日）

負債の部

流動負債

未払金	6,021
未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474

流動負債合計	11,243
--------	--------

固定負債

退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7

固定負債合計	2,619
--------	-------

負債合計

13,862

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	6,968
---------	-------

利益剰余金合計	7,343
---------	-------

株主資本合計

34,013

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	10
--------------	----

評価・換算差額等合計	10
------------	----

純資産合計

34,023

負債・純資産合計

47,886

(2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

当中間会計期間

（自 2019年4月1日

至 2019年9月30日）

営業収益

委託者報酬 35,076

その他営業収益 309

営業収益合計 35,385

営業費用

支払手数料 15,895

その他営業費用 6,272

営業費用合計 22,167

一般管理費

1 5,954

営業利益

7,263

営業外収益

2 968

営業外費用

3 148

経常利益

8,083

特別利益

-

特別損失

-

税引前中間純利益

8,083

法人税、住民税及び事業税

2,313

法人税等調整額

15

中間純利益

5,785

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868

中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
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	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	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	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

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）子会社及び関連会社株式

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

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。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 (2019年9月30日現在)	
有形固定資産	310百万円

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（2019年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
受取配当金	901百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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
----	-----------	-----------------	-----------------	-----	-------

2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年3月31 日	2019年6月24日
----------------------	------	--------	-------	----------------	------------

（金融商品関係）

当中間会計期間（2019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(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	19,529	19,529	-
(2) 未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1) 未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2) 未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

（*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	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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（2019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 1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827百万円）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	66	55	11
（２）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
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	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019年9月30日）	
1 株当たり純資産額	13,043.35円
1 株当たり中間純利益	2,217.93円

（注1）潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
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。

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	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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019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、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年4月17日

大和アセットマネジメント株式会社

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」に掲げられているロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） - （為替ヘッジあり）の2019年9月14日から2020年3月13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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） - （為替ヘッジあり）の2020年3月13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9月14日から2020年3月13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

大和アセットマネジメント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。