

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成31年2月26日提出
【計算期間】	第14計算期間中 (自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日)
【ファンド名】	ダイワ・ライフ・バランス 7 0
【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
【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】（2018年12月28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	6,147,005,699	99.60
内 日本	6,147,005,699	99.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,638,853	0.40
純資産総額	6,171,644,552	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4計算期間末 (2009年6月5日)	17,846,547	17,846,547	0.9267	0.9267
第5計算期間末 (2010年6月7日)	112,159,158	112,159,158	0.9177	0.9177
第6計算期間末 (2011年6月6日)	359,093,189	359,093,189	0.9396	0.9396
第7計算期間末 (2012年6月5日)	1,208,963,087	1,208,963,087	0.8732	0.8732
第8計算期間末 (2013年6月5日)	2,081,871,172	2,081,871,172	1.2586	1.2586
第9計算期間末 (2014年6月5日)	2,725,931,441	2,725,931,441	1.4313	1.4313
第10計算期間末 (2015年6月5日)	3,825,801,208	3,825,801,208	1.7864	1.7864
第11計算期間末 (2016年6月6日)	3,825,740,833	3,825,740,833	1.5681	1.5681
第12計算期間末 (2017年6月5日)	4,710,824,279	4,710,824,279	1.8085	1.8085
2017年12月末日	5,558,814,652	-	1.9858	-
2018年1月末日	5,775,907,498	-	1.9950	-
2月末日	5,660,282,847	-	1.9362	-
3月末日	5,654,040,063	-	1.8999	-

4月末日	5,876,238,333	-	1.9530	-
5月末日	5,978,807,666	-	1.9368	-
第13計算期間末 (2018年6月5日)	6,062,194,684	6,062,194,684	1.9623	1.9623
6月末日	6,104,870,604	-	1.9361	-
7月末日	6,290,842,422	-	1.9669	-
8月末日	6,499,754,813	-	1.9662	-
9月末日	6,706,904,976	-	2.0298	-
10月末日	6,386,520,019	-	1.8947	-
11月末日	6,619,695,914	-	1.9198	-
12月末日	6,171,644,552	-	1.7828	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2018年6月6日～ 2018年12月5日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	26.0
第5計算期間	1.0
第6計算期間	2.4
第7計算期間	7.1
第8計算期間	44.1
第9計算期間	13.7
第10計算期間	24.8
第11計算期間	12.2
第12計算期間	15.3
第13計算期間	8.5

2018年6月6日～ 2018年12月5日	3.2
--------------------------	-----

（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（2018年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	126,934,755,960	99.32
内 日本	126,934,755,960	99.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	866,768,402	0.68
純資産総額	127,801,524,362	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)	1,164,930,000	0.91
内 日本	1,164,930,000	0.91

(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。

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（2018年12月28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	14,119,571,000	82.18
内 日本	14,119,571,000	82.18
地方債証券	936,803,200	5.45
内 日本	936,803,200	5.45
特殊債券	918,823,300	5.35
内 日本	918,823,300	5.35
社債券	1,043,784,100	6.08
内 日本	1,043,784,100	6.08

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	161,942,336	0.94
純資産総額	17,180,923,936	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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2018年12月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		92,885,844,426	96.17
	内 香港	1,342,388,730	1.39
	内 シンガポール	455,018,383	0.47
	内 イスラエル	199,659,404	0.21
	内 ノルウェー	263,521,890	0.27
	内 スウェーデン	977,345,398	1.01
	内 デンマーク	638,847,879	0.66
	内 イギリス	6,101,808,112	6.32
	内 アイルランド	193,700,629	0.20
	内 オランダ	1,253,075,917	1.30
	内 ベルギー	347,379,075	0.36
	内 フランス	3,911,493,425	4.05
	内 ドイツ	3,245,257,893	3.36
	内 スイス	3,143,115,547	3.25
	内 ポルトガル	56,068,722	0.06
	内 スペイン	1,130,840,872	1.17
	内 イタリア	831,263,744	0.86
	内 フィンランド	380,959,996	0.39
	内 オーストリア	85,001,545	0.09
	内 カナダ	3,492,685,376	3.62
	内 アメリカ	62,474,396,093	64.69
	内 オーストラリア	2,279,480,742	2.36
	内 ニュージーランド	82,535,054	0.09
投資証券		2,610,827,491	2.70
	内 香港	86,887,737	0.09
	内 シンガポール	45,272,844	0.05
	内 イギリス	73,638,306	0.08

	内 フランス	118,227,857	0.12
	内 カナダ	17,467,046	0.02
	内 アメリカ	1,968,727,292	2.04
	内 オーストラリア	300,606,409	0.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,083,438,209	1.12
純資産総額		96,580,110,126	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）		1,149,321,750	1.19
	内 アメリカ	1,149,321,750	1.19
為替予約取引（買建）		121,957,000	0.13
	内 日本	121,957,000	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) 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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2018年12月28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		166,080,392,814	98.59
	内 ユーロ	65,288,341,962	38.76
	内 シンガポール	653,743,214	0.39
	内 マレーシア	742,194,279	0.44
	内 ノルウェー	377,929,932	0.22
	内 スウェーデン	611,421,455	0.36
	内 デンマーク	878,698,388	0.52
	内 イギリス	10,915,404,212	6.48
	内 ポーランド	1,006,941,252	0.60
	内 カナダ	3,254,979,990	1.93
	内 アメリカ	76,643,700,504	45.50
	内 メキシコ	1,350,873,476	0.80

	内 南アフリカ	931,526,236	0.55
	内 オーストラリア	3,424,637,914	2.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,377,988,011	1.41
純資産総額		168,458,380,825	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)		879,503,290	0.52
	内 日本	879,503,290	0.52

(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。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ・ライフ・バランス70

2018年12月28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	17,828円
純資産総額	61億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-7.1%
3カ月間	-12.2%
6カ月間	-7.9%
1年間	-10.2%
3年間	4.3%
5年間	23.4%
設定来	78.3%



※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2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	07年6月	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月	14年6月	15年6月	16年6月	17年6月	18年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

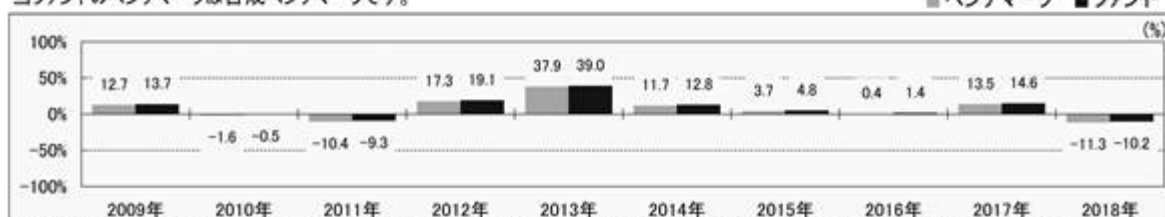
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,097	44.0%	日本円	65.3%	直接利回り(%)	1.4	トヨタ自動車	日本	1.5%
外国株式・先物	1,244	23.7%	米ドル	21.4%	最終利回り(%)	0.7	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%
国内債券	269	20.8%	ユーロ	7.0%	修正デュレーション	8.5	ソニー	日本	0.7%
外国債券	761	10.2%	英ポンド	2.2%	残存年数	9.8	日本電信電話	日本	0.6%
外国リート	63	0.6%	カナダ・ドル	1.1%	債券格付別構成	比率	ソフトバンクグループ	日本	0.6%
外国投資証券	6	0.0%	豪ドル	0.9%	AAA	85.8%	キーエンス	日本	0.6%
			スイス・フラン	0.8%	AA	6.9%	APPLE INC	アメリカ	0.6%
			香港ドル	0.3%	A	5.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%
			スウェーデン・クロネ	0.3%	BBB	0.2%	三井住友フィナンシャルG	日本	0.5%
コール・ローン、その他	1.3%	その他	0.8%	BB以下・無格付	2.1%	本田技研	日本	0.5%	
合計	4,440	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		6.9%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。

■ベンチマーク ■ファンド



・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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2018年は12月28日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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

2 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	39,662,604	21,405,002
第5計算期間	126,156,157	23,194,258
第6計算期間	289,830,509	29,861,276
第7計算期間	1,122,159,350	119,875,964
第8計算期間	507,894,095	238,281,222
第9計算期間	603,882,364	353,516,691
第10計算期間	656,287,666	419,084,684
第11計算期間	794,789,749	496,658,896
第12計算期間	690,779,192	525,696,208
第13計算期間	977,998,408	493,482,793
2018年6月6日～ 2018年12月5日	602,351,241	241,409,477

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（平成30年6月6日から平成30年12月5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。

ダイワ・ライフ・バランス70

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成30年6月5日現在	当中間計算期間末 平成30年12月5日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	15,489,381	714,884
コール・ローン	23,032,831	35,069,234
親投資信託受益証券	6,038,476,060	6,525,336,940
未収入金	1,586,000	-
流動資産合計	6,078,584,272	6,561,121,058
資産合計	6,078,584,272	6,561,121,058
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,390,222	1,669,934
未払受託者報酬	922,887	1,032,546
未払委託者報酬	5,845,152	6,539,639
その他未払費用	231,327	258,576
流動負債合計	16,389,588	9,500,695
負債合計	16,389,588	9,500,695
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,089,383,100	1 3,450,324,864
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,972,811,584	3,101,295,499
（分配準備積立金）	1,194,703,503	1,109,609,248
元本等合計	6,062,194,684	6,551,620,363
純資産合計	6,062,194,684	6,551,620,363
負債純資産合計	6,078,584,272	6,561,121,058

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成29年6月6日 至 平成29年12月5日	当中間計算期間 自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
営業収益		
受取利息	-	7
有価証券売買等損益	415,966,781	199,945,120
営業収益合計	415,966,781	199,945,113
営業費用		
支払利息	7,940	12,266
受託者報酬	816,483	1,032,546
委託者報酬	5,171,233	6,539,639
その他費用	204,021	260,277
営業費用合計	6,199,677	7,844,728
営業利益又は営業損失（ ）	409,767,104	207,789,841
経常利益又は経常損失（ ）	409,767,104	207,789,841
中間純利益又は中間純損失（ ）	409,767,104	207,789,841
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（ ）	18,672,337	362,128
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,105,956,794	2,972,811,584
剰余金増加額又は欠損金減少額	371,870,744	568,024,073
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	371,870,744	568,024,073
剰余金減少額又は欠損金増加額	215,569,920	232,112,445
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	215,569,920	232,112,445
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,653,352,385	3,101,295,499

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 平成30年6月5日現在	当中間計算期間末 平成30年12月5日現在
1. 1 期首元本額	2,604,867,485円	3,089,383,100円
期中追加設定元本額	977,998,408円	602,351,241円
期中一部解約元本額	493,482,793円	241,409,477円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,089,383,100口	3,450,324,864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 自 平成29年6月6日 至 平成29年12月5日	当中間計算期間 自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5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 平成30年12月5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 平成30年6月5日現在	当中間計算期間末 平成30年12月5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 平成30年6月5日現在	当中間計算期間末 平成30年12月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9623円 (19,623円)	1.8988円 (18,988円)

（参考）

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,901,628,923	336,703,049
コール・ローン	5,801,752,917	16,517,241,552
株式 2 3	142,963,744,470	138,454,705,710
派生商品評価勘定	38,441,820	6,164,340
未収配当金	1,047,473,250	275,176,218

未収利息	942,016	1,473,481
前払金	-	1,120,000
その他未収収益 4	20,828,650	9,414,405
流動資産合計	153,774,812,046	155,601,998,755
資産合計	153,774,812,046	155,601,998,755
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,527,280	18,992,660
前受金	40,445,000	-
未払金	-	1,502,160
未払解約金	16,478,700	84,813,600
受入担保金	8,128,865,010	15,247,518,856
その他未払費用	200,293	243,338
流動負債合計	8,188,516,283	15,353,070,614
負債合計	8,188,516,283	15,353,070,614
純資産の部		
元本等		
元本 1	130,544,614,080	134,832,238,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,041,681,683	5,416,689,411
元本等合計	145,586,295,763	140,248,928,141
純資産合計	145,586,295,763	140,248,928,141
負債純資産合計	153,774,812,046	155,601,998,755

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1. 1 期首	平成29年6月6日	平成30年6月6日
期首元本額	134,619,084,916円	130,544,614,080円
期中追加設定元本額	16,350,943,105円	9,309,548,733円
期中一部解約元本額	20,425,413,941円	5,021,924,083円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス	4,162,592,447円	4,196,779,757円
ファンド		

ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	9,720,485,226円	8,873,177,226円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	61,533,489円	50,889,255円
ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	71,040,156円	65,059,832円
ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募)	1,185,083,183円	1,051,679,305円
ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	58,786,280円	59,055,392円
ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募)	1,629,722,011円	1,449,339,094円
日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	- 円	4,560,516円
D - I ' s T O P I Xインデックス	27,080,146円	39,577,392円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	21,745,004円	19,502,591円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	637,974円	687,039円
i F r e e T O P I Xインデックス	500,181,562円	780,835,739円
i F r e e 8資産バランス	870,549,977円	1,281,782,665円
i F r e e 年金バランス	- 円	19,007,359円
D Cダイワ日本株式インデックス	62,916,207,863円	65,478,298,293円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,334,266,744円	2,604,113,138円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,511,161,219円	2,907,019,868円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,431,889,390円	2,809,970,952円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,410,452,878円	4,625,751,664円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2020	15,008,044円	15,108,787円

D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,058,874円	52,618,275円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,593,445円	16,816,766円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	10,017,697円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	330,547円	350,718円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	338,072円	359,201円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA（国内株式型）	676,615円	712,052円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	2,160,411円	4,149,572円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,779,668円	4,912,940円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA（国内株式型）	10,239,884円	9,756,807円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	234,954,399円	184,088,109円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	162,509,645円	161,522,359円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,996,448,139円	9,658,927,568円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	58,004,356円	11,266,082円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	53,103,500円	14,433,489円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	859,818,096円	823,652,210円
ダイワ国内バランスファンド 25VA（適格機関投資家専 用）	129,181,252円	129,734,372円
ダイワ国内バランスファンド 30VA（適格機関投資家専 用）	225,110,840円	221,128,598円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	103,353,224円	138,409,154円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,527,101,920円	8,514,689,791円

	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	89,520,884円	292,427,555円
	ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	1,713,359,066円	1,908,663,833円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,352,677,991円	1,394,507,719円
	ダイワライフスタイル２５	174,970,735円	181,369,214円
	ダイワライフスタイル５０	616,175,702円	649,148,174円
	ダイワライフスタイル７５	522,270,600円	544,757,466円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	13,715,452,622円	13,571,623,145円
計		130,544,614,080円	134,832,238,730円
2.	期末日における受益権の総数	130,544,614,080口	134,832,238,730口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,846,685,150円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,072,258,410円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 734,500,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 691,000,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分18,774,762円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分6,286,785円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成30年6月5日 現在				平成30年12月5日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	2,607,870,000	-	2,643,865,000	35,995,000	1,780,730,000	-	1,767,960,000	12,770,000
合計	2,607,870,000	-	2,643,865,000	35,995,000	1,780,730,000	-	1,767,960,000	12,770,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.1152円	1.0402円
（1万口当たり純資産額）	(11,152円)	(10,402円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	25,123,383	2,601,927
コール・ローン	37,358,669	127,639,661
国債証券	12,625,182,130	14,031,463,120
地方債証券	1,142,002,100	1,037,262,000
特殊債券	918,794,500	918,349,200
社債券	1,229,222,300	1,042,763,500
未収利息	43,890,915	46,412,932
前払費用	2,252,809	1,012,452
流動資産合計	16,023,826,806	17,207,504,792
資産合計	16,023,826,806	17,207,504,792
負債の部		
流動負債		
未払金	-	61,205,770
未払解約金	11,211,874	2,163,775
その他未払費用	2,638	1,228
流動負債合計	11,214,512	63,370,773
負債合計	11,214,512	63,370,773
純資産の部		
元本等		
元本 1	12,561,819,123	13,457,638,144
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,450,793,171	3,686,495,875
元本等合計	16,012,612,294	17,144,134,019
純資産合計	16,012,612,294	17,144,134,019
負債純資産合計	16,023,826,806	17,207,504,792

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1. 1 期首	平成29年6月6日	平成30年6月6日
期首元本額	12,338,211,994円	12,561,819,123円
期中追加設定元本額	2,631,454,387円	1,278,054,416円
期中一部解約元本額	2,407,847,258円	382,235,395円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	- 円	12,669,710円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2050	57,799円	59,366円
i F r e e 日本債券イン デックス	101,944,203円	114,883,783円
i F r e e 8 資産バランス ダイワ・ライフ・バランス 3 0	757,841,093円	1,060,980,050円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	5,575,191,411円	5,864,854,483円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	2,918,530,812円	3,186,852,570円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽ノ安定コース）	947,064,773円	1,031,282,946円
	638,224,393円	712,268,232円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	522,040,298円	574,262,009円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	164,504,376円	179,025,968円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	59,408,980円	56,580,475円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	49,467,428円	51,508,402円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,694,021円	5,092,545円
ダイワつみたてインデックス日本債券	- 円	3,404,777円
ダイワ世界バランスファンド40VA	513,344,330円	382,555,859円
ダイワ世界バランスファンド60VA	213,509,760円	200,308,367円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	50,296,094円	9,281,150円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	45,699,352円	11,767,452円
計	12,561,819,123円	13,457,638,144円
2. 期末日における受益権の総数	12,561,819,123口	13,457,638,144口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年6月5日現在	平成30年12月5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）

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1口当たり純資産額	1.2747円	1.2739円
（1万口当たり純資産額）	（12,747円）	（12,739円）

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	762,623,208	250,828,871
金銭信託	53,514,619	1,611,640
コール・ローン	79,576,659	79,060,313
株式	98,105,026,572	102,057,677,258
投資証券	2,496,728,263	2,820,711,690
派生商品評価勘定	30,585,522	7,664,552
未収入金	104,521,610	2,071,211
未収配当金	187,496,115	180,821,267
差入委託証拠金	741,863,712	793,334,585
流動資産合計	102,561,936,280	106,193,781,387
資産合計	102,561,936,280	106,193,781,387
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	6,621,808
未払金	563,380,429	32,468,294
未払解約金	17,484,100	54,682,600
その他未払費用	2,596,447	8,100
流動負債合計	583,460,976	93,780,802
負債合計	583,460,976	93,780,802
純資産の部		
元本等		
元本	1 41,789,264,029	43,969,391,569

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	60,189,211,275	62,130,609,016
元本等合計	101,978,475,304	106,100,000,585
純資産合計	101,978,475,304	106,100,000,585
負債純資産合計	102,561,936,280	106,193,781,387

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. 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。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1. 1 期首	平成29年6月6日	平成30年6月6日
期首元本額	39,805,675,154円	41,789,264,029円
期中追加設定元本額	6,682,593,477円	3,605,399,832円
期中一部解約元本額	4,699,004,602円	1,425,272,292円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックス	516,810,268円	502,335,379円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド３０ＶＡ(一般投資家私 募)	16,429,883円	14,096,372円
ダイワ国内重視バランスファン ド５０ＶＡ(一般投資家私 募)	233,161,261円	195,832,529円
ダイワ国際分散バランスファン ド３０ＶＡ(一般投資家私 募)	26,978,339円	25,055,668円
ダイワ国際分散バランスファン ド５０ＶＡ(一般投資家私 募)	749,390,377円	626,498,618円
外国株式インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	- 円	821,000円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジングプラス（為替ヘッジな し）	545,958,104円	552,665,399円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス（為替ヘッ ジなし）	1,346,778,483円	1,478,307,270円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマーキングプラス（為替 ヘッジなし）	485,740,600円	531,470,011円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,010,996円	5,542,164円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	195,844円	197,868円
i F r e e 外国株式イン デックス（為替ヘッジなし）	527,533,212円	729,504,513円
i F r e e ８資産バランス	400,480,504円	557,965,043円
i F r e e 年金バランス	- 円	8,208,375円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	25,626,982,790円	27,644,770,748円
ダイワ・ライフ・バランス３ ０	545,008,515円	569,101,264円
ダイワ・ライフ・バランス５ ０	769,127,059円	839,595,806円
ダイワ・ライフ・バランス７ ０	621,040,266円	676,868,528円

	大和D C 海外株式インデックスファンド	1,474,573,333円	1,489,371,049円
	D C ダイワ・ターゲットイヤー2020	4,413,137円	4,144,265円
	D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	13,149,627円	13,249,619円
	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	3,879,429円	4,210,339円
	ダイワつみたてインデックス外国株式	- 円	4,635,759円
	ダイワ世界分散バランスファンド15VA	77,536円	76,173円
	ダイワ世界分散バランスファンド20VA	158,798円	156,042円
	ダイワ世界分散バランスファンド25VA	675,106円	1,204,032円
	ダイワ世界分散バランスファンド30VA	2,241,162円	2,140,945円
	ダイワ世界バランスファンド40VA	324,778,874円	237,257,604円
	ダイワ世界バランスファンド60VA	376,573,646円	348,671,890円
	ダイワ・バランスファンド35VA	3,461,884,926円	3,137,819,193円
	ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	170,696,684円	153,767,963円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	587,946,920円	633,369,020円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	62,630,901円	87,925,953円
	ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	463,630円	453,703円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,741,000,970円	2,743,706,450円
	ダイワライフスタイル25	20,140,252円	19,463,084円
	ダイワライフスタイル50	71,155,924円	70,090,381円
	ダイワライフスタイル75	60,196,673円	58,841,550円
計		41,789,264,029円	43,969,391,569円
2.	期末日における受益権の総数	41,789,264,029口	43,969,391,569口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成30年6月5日 現在				平成30年12月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	1,312,836,390	-	1,342,944,852	30,108,462	1,218,618,616	-	1,219,894,160	1,275,544
合計	1,312,836,390	-	1,342,944,852	30,108,462	1,218,618,616	-	1,219,894,160	1,275,544

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種 類	平成30年6月5日 現在				平成30年12月5日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	98,243,940	-	98,721,000	477,060	33,958,800	-	33,726,000	232,800
アメリカ・ドル	98,243,940	-	98,721,000	477,060	33,958,800	-	33,726,000	232,800
合計	98,243,940	-	98,721,000	477,060	33,958,800	-	33,726,000	232,800

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1口当たり純資産額	2.4403円	2.4130円
(1万口当たり純資産額)	(24,403円)	(24,130円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,067,386,484	2,665,284,658
金銭信託	353,158,673	16,767,678
コール・ローン	525,149,726	822,552,058
国債証券	162,140,109,061	167,076,384,264
派生商品評価勘定	9,444,566	37,737
未収入金	975,445	8,919
未収利息	1,190,123,498	1,202,266,601
前払費用	29,234,241	30,847,549
流動資産合計	167,315,581,694	171,814,149,464
資産合計	167,315,581,694	171,814,149,464
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,264,184
未払金	2,699,486,415	2,537,585,422
未払解約金	51,732,610	69,064,702
その他未払費用	18,891	13,881
流動負債合計	2,751,237,916	2,611,928,189
負債合計	2,751,237,916	2,611,928,189
純資産の部		
元本等		
元本	1 60,553,811,990	61,421,435,249
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	104,010,531,788	107,780,786,026
元本等合計	164,564,343,778	169,202,221,275
純資産合計	164,564,343,778	169,202,221,275
負債純資産合計	167,315,581,694	171,814,149,464

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年6月6日 至 平成30年12月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
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。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1. 1 期首 期首元本額	平成29年6月6日 59,593,264,615円	平成30年6月6日 60,553,811,990円

期中追加設定元本額	6,491,291,088円	2,925,249,488円
期中一部解約元本額	5,530,743,713円	2,057,626,229円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	854,739,148円	693,445,099円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	29,450,309円	26,063,629円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	207,958,349円	172,071,534円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	56,669,778円	53,368,772円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	669,100,642円	558,517,187円
外国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	2,203,038円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマージ ングプラス(為替ヘッジな し)	353,042,211円	359,482,218円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	878,016,648円	1,078,551,511円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	634,437,238円	708,043,425円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	935,352円	731,384円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,099円	27,109円
i F r e e 外国債券イン デックス	429,890,629円	497,130,052円
i F r e e 8資産バランス	357,073,139円	489,531,767円
i F r e e 年金バランス	- 円	4,368,354円

D C ダイワ外国債券インデックス	41,248,128,869円	42,448,223,492円
ダイワ・ライフ・バランス 30	716,722,091円	739,817,221円
ダイワ・ライフ・バランス 50	344,209,469円	368,136,096円
ダイワ・ライフ・バランス 70	222,130,841円	237,901,138円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）	301,568,386円	329,404,452円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6 分散コース）	246,615,112円	264,982,125円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	78,174,552円	82,555,008円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2020	11,141,325円	10,493,409円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	18,254,695円	18,731,042円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	1,736,790円	1,851,074円
ダイワつみたてインデックス外国債券	- 円	1,218,113円
ダイワ世界バランスファンド 40 V A	338,604,323円	246,851,720円
ダイワ世界バランスファンド 60 V A	168,002,343円	154,628,203円
ダイワ・バランスファンド 35 V A	6,143,671,153円	5,670,820,521円
ダイワ・ワールド・バランスファンド 50 V A	94,326,977円	17,267,757円
ダイワ・ワールド・バランスファンド 75 V A	32,619,487円	8,186,659円
ダイワ・バランスファンド 25 V A（適格機関投資家専用）	349,404,648円	328,246,489円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	138,957,693円	142,947,787円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	26,990,140円	28,212,318円

ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	373,707円	27,731,702円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,483,731,482円	5,534,504,462円
ダイワライフスタイル25	35,965,029円	35,238,293円
ダイワライフスタイル50	63,227,770円	62,409,047円
ダイワライフスタイル75	17,914,566円	17,542,042円
計	60,553,811,990円	61,421,435,249円
2. 期末日における受益権の総数	60,553,811,990口	61,421,435,249口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年12月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成30年6月5日 現在				平成30年12月5日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								

売 建	-	-	-	-	39,963,296	-	39,955,480	7,816
イギリス・ポンド	-	-	-	-	5,022,150	-	5,021,800	350
カナダ・ドル	-	-	-	-	29,086,279	-	29,083,680	2,599
スウェーデン・ クローナ	-	-	-	-	5,854,867	-	5,850,000	4,867
買 建	749,028,496	-	758,473,062	9,444,566	718,232,793	-	712,998,530	5,234,263
アメリカ・ドル	323,532,560	-	327,264,930	3,732,370	212,659,637	-	211,635,000	1,024,637
イギリス・ポンド	50,138,238	-	50,759,160	620,922	42,976,998	-	42,551,190	425,808
オーストラリア・ ドル	16,985,074	-	17,352,810	367,736	14,552,556	-	14,474,240	78,316
カナダ・ドル	16,648,101	-	16,891,120	243,019	24,168,655	-	24,088,880	79,775
シンガポール・ ドル	-	-	-	-	12,623,052	-	12,604,140	18,912
デンマーク・ クローネ	6,223,039	-	6,307,332	84,293	28,784,040	-	28,520,450	263,590
ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	7,193,659	-	7,223,580	29,921
ポーランド・ ズロチ	-	-	-	-	10,785,429	-	10,698,200	87,229
メキシコ・ペソ	15,871,398	-	15,985,920	114,522	-	-	-	-
ユーロ	304,397,650	-	308,391,450	3,993,800	364,488,767	-	361,202,850	3,285,917
南アフリカ・ ランド	15,232,436	-	15,520,340	287,904	-	-	-	-
合計	749,028,496	-	758,473,062	9,444,566	758,196,089	-	752,954,010	5,226,447

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	平成30年6月5日現在	平成30年12月5日現在
1口当たり純資産額	2.7177円	2.7548円
（1万口当たり純資産額）	(27,177円)	(27,548円)

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2018年12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。

2018年12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	80	164,607
追加型株式投資信託	718	14,301,647
株式投資信託 合計	798	14,466,254
単位型公社債投資信託	30	114,477
追加型公社債投資信託	14	1,406,818
公社債投資信託 合計	44	1,521,295
総合計	842	15,987,549

(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

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。

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59期事業年度（平成29年4月1日から平成30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60期事業年度に係る中間会計期間（2018年4月1日から2018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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1 229	1 213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066

投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成29年 3月31日）	当事業年度 （平成30年 3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
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	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973

賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31 日）	当事業年度 （自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日）
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

十期報告書（内国投資信託）

	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	13,370	13,744	40,414

	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	40,631

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」に独立掲記しておりました「受取利息」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「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成30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。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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

（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30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	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26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、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、

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（平成29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	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 その他有価証券	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(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*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（平成30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 其他有価証券	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。

（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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	970	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	1,050	1,072

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 その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

当事業年度（平成30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

（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。

当事業年度（平成30年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成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「其他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成30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「其他有価証券」には含めておりません。

３．売却した其他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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

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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

（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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円

その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

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173百万円、当事業年度171百万円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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29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（平成30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 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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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㈱	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。

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,533	12,670
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 (2018年 9 月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,097
有価証券		0
未収委託者報酬		12,445
その他		2,329
流動資産合計		35,872
固定資産		
有形固定資産	1	199
無形固定資産		
ソフトウェア		2,162
その他		449
無形固定資産合計		2,612
投資その他の資産		
投資有価証券		7,521
関係会社株式		1,836
繰延税金資産		964
その他		1,286
投資その他の資産合計		11,608
固定資産合計		14,420
資産合計		50,293

(単位: 百万円)

		当中間会計期間 (2018年 9 月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,165
未払費用		3,666

未払法人税等	859
賞与引当金	611
その他	2 552
流動負債合計	12,855
固定負債	
退職給付引当金	2,335
役員退職慰労引当金	144
その他	3
固定負債合計	2,483
負債合計	15,338
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	7,643
利益剰余金合計	8,017
株主資本合計	34,687
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	34,955
負債・純資産合計	50,293

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間	
(自 2018年4月1日	
至 2018年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	39,713
その他営業収益	351
営業収益合計	40,065
営業費用	
支払手数料	18,868
その他営業費用	6,357

営業費用合計		25,226
一般管理費	1	5,925
営業利益		8,913
営業外収益	2	418
営業外費用	3	86
経常利益		9,244
特別利益		-
特別損失	4	29
税引前中間純利益		9,215
法人税、住民税及び事業税		2,628
法人税等調整額		125
中間純利益		6,462

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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	13,370	13,744	40,414
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	13,850	14,225	40,895
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
中間純利益	-	-	-	6,462	6,462	6,462
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	-	-	-	6,207	6,207	6,207
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,643	8,017	34,687

	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	40,631
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			41,112
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
中間純利益	-	-	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	50	50	50
当中間期変動額合計	50	50	6,156
当中間期末残高	267	267	34,955

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。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。

（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）を当中間会計期間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期首残高が480百万円増加しております。

（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）等を当中間会計期間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。

（中間貸借対照表関係）

１ 減価償却累計額

当中間会計期間

（2018年9月30日現在）

有形固定資産	280百万円
--------	--------

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（2018年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,743百万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 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	436百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
有価証券償還益	132百万円
投資有価証券売却益	124百万円
為替差益	104百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
有価証券償還損	32百万円
投資有価証券売却損	24百万円
固定資産除却損	13百万円

4 特別損失の主要項目

当中間会計期間

（自 2018年 4 月 1 日

至 2018年 9 月30日）

関係会社整理損失

29百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2018年 4 月 1 日 至 2018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
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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2018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	21,097	21,097	-
(2) 未収委託者報酬	12,445	12,445	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,551	6,551	-
資産合計	40,094	40,094	-
(1) 未払金	(7,096)	(7,096)	-
(2) 未払費用(*2)	(3,089)	(3,089)	-
負債合計	(10,186)	(10,186)	-

(*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	970
子会社株式	1,836
差入保証金	1,071

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（2018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）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	129	55	74
（２）その他			

証券投資信託	4,148	3,765	383
小計	4,277	3,820	457
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,274	2,378	104
小計	2,274	2,378	104
合計	6,551	6,198	352

（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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
1株当たり純資産額	13,400.41円
1株当たり中間純利益	2,477.30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おりません。

（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 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
中間純利益(百万円)	6,462
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,462
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

平成30年 5月25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30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。

独立監査人の中間監査報告書

2018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期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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2018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（2018年4月1日から2018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

平成31年1月11日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	深井 康治	印
業務執行社員			

指定有限責任社員	公認会計士	小林 英之	印
業務執行社員			

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス70の平成30年6月6日から平成30年12月5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、ダイワ・ライフ・バランス70の平成30年12月5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30年6月6日から平成30年12月5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。