

【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3月8日提出
【計算期間】	第3計算期間中 (自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15日)
【ファンド名】	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス ダイワファンドラップ 日経225インデックス ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 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) 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) ダイワファンドラップ 日本債券インデックス ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) 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) 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) ダイワファンドラップ J-REITインデックス ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)
【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】	松葉 恭明
【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】

【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

(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	7,817,230,735	99.99
内 日本	7,817,230,735	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	475,492	0.01
純資産総額	7,817,706,227	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6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
2017年12月末日	7,500,922,307	-	1.3821	-
2018年1月末日	7,477,006,509	-	1.3962	-
2月末日	7,537,606,396	-	1.3445	-
3月末日	7,795,747,092	-	1.3168	-
4月末日	8,380,191,011	-	1.3635	-
5月末日	8,226,478,637	-	1.3409	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
6月末日	8,341,958,589	-	1.3293	-
7月末日	8,725,005,064	-	1.3462	-
8月末日	8,880,286,436	-	1.3322	-
9月末日	9,580,965,511	-	1.4058	-
10月末日	8,795,116,627	-	1.2727	-
11月末日	8,992,478,730	-	1.2892	-
12月末日	7,817,706,227	-	1.1568	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.6
第2計算期間	14.7
2018年6月16日～ 2018年12月15日	10.3

(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。

(参考情報) 運用実績

●FW TOPIXインデックス

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	11,568円
純資産総額	78億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-10.3%
3カ月間	-17.7%
6カ月間	-13.0%
1年間	-16.3%
3年間	-
5年間	-
設定来	15.7%

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	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6月	第2期 18年6月		
分配金	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。

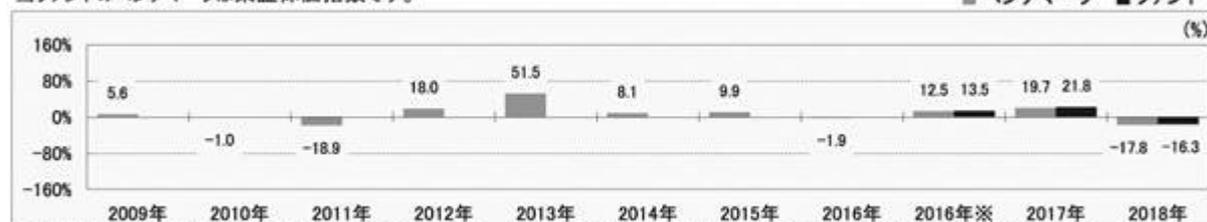
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,096	99.3%	電気機器	12.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
国内株式先物	1	0.9%	輸送用機器	8.3%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.7%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.5%	ソニー	電気機器	1.7%
コール・ローン、その他		0.7%	情報・通信業	7.4%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
合計	2,097	-	銀行業	6.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
株式市場・上場別構成			小売業	5.2%	キーエンス	電気機器	1.3%
一部(東証・名証)		99.3%	卸売業	5.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.2%
二部(東証・名証)		-	陸運業	4.9%	本田技研	輸送用機器	1.1%
新興市場他		-	医薬品	4.9%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.1%
その他		-	その他	37.0%	KDDI	情報・通信業	1.1%
合計		99.3%	合計	99.3%	合計		15.4%

※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東証株価指数です。

■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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

(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	6,227,286,253	99.98
内 日本	6,227,286,253	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,053,521	0.02
純資産総額	6,228,339,774	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6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
2017年12月末日	5,044,106,735	-	1.3899	-
2018年1月末日	5,222,768,858	-	1.4100	-
2月末日	5,235,421,887	-	1.3480	-
3月末日	6,091,987,612	-	1.3199	-
4月末日	6,411,354,926	-	1.3824	-
5月末日	6,468,097,774	-	1.3659	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
6月末日	6,380,105,672	-	1.3736	-
7月末日	6,497,247,951	-	1.3886	-
8月末日	6,657,125,829	-	1.4081	-
9月末日	7,095,028,830	-	1.4949	-
10月末日	6,508,089,168	-	1.3593	-
11月末日	6,805,047,215	-	1.3859	-
12月末日	6,228,339,774	-	1.2432	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第1計算期間	20.1
第2計算期間	17.1
2018年6月16日～ 2018年12月15日	5.7

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・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	158,894,916,600	98.28
内 日本	158,894,916,600	98.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,786,397,337	1.72
純資産総額	161,681,313,937	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,780,000,000	1.72
内 日本	2,780,000,000	1.72

(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。

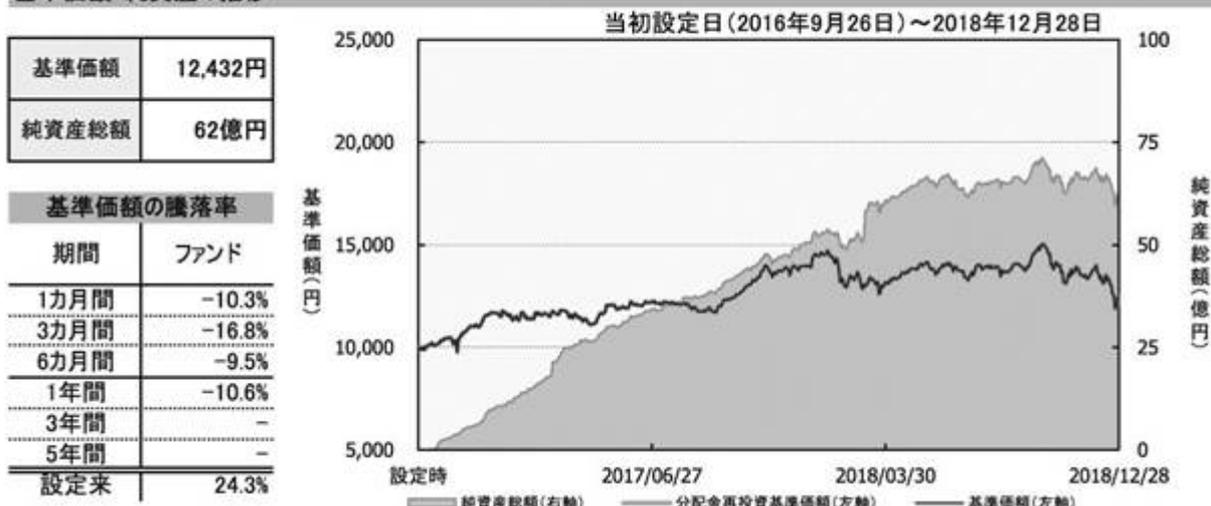
(参考情報) 運用実績

●FW 日経225インデックス

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



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	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。

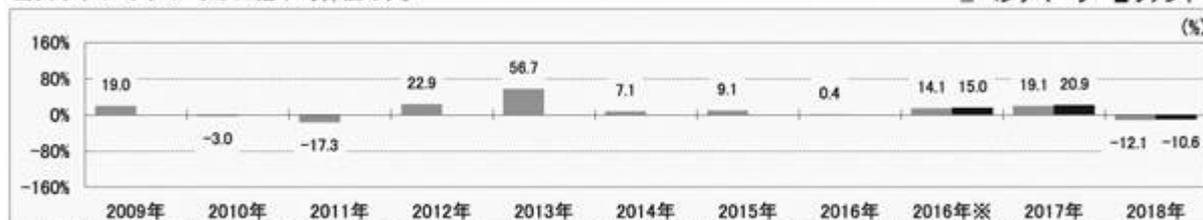
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	225	98.3%	電気機器	15.5%	ファーストリテイリング	小売業	10.2%
国内株式先物	1	1.7%	小売業	14.9%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.0%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	10.2%	ファナック	電気機器	3.0%
コール・ローン、その他	-	-	化学	8.6%	KDDI	情報・通信業	2.9%
合計	226	-	医薬品	8.3%	ユニー・ファミリーマートHD	小売業	2.5%
株式市場・上場別構成		比率	輸送用機器	5.5%	東京エレクトロン	電気機器	2.3%
一部(東証・名証)		98.3%	食料品	4.8%	テルモ	精密機器	2.3%
二部(東証・名証)		-	サービス業	4.7%	ダイキン工業	機械	2.1%
新興市場他		-	機械	4.5%	京セラ	電気機器	2.0%
その他		-	その他	21.1%	NK225先物 3103月	-	1.7%
合計		98.3%	合計	98.3%	合計		33.0%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均株価です。

■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。

*2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

(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	30,774,060,175	99.99
内 日本	30,774,060,175	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,271,671	0.01
純資産総額	30,777,331,846	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6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
2017年12月末日	25,282,714,256	-	1.2059	-
2018年1月末日	27,267,895,034	-	1.2466	-
2月末日	27,921,902,626	-	1.2135	-
3月末日	28,875,017,873	-	1.1725	-
4月末日	29,944,517,774	-	1.1942	-
5月末日	30,810,158,577	-	1.2152	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
6月末日	31,198,358,015	-	1.2080	-
7月末日	32,728,215,901	-	1.2442	-
8月末日	34,170,120,356	-	1.2700	-
9月末日	34,900,797,410	-	1.2717	-
10月末日	32,405,013,032	-	1.1693	-
11月末日	33,535,301,641	-	1.1901	-
12月末日	30,777,331,846	-	1.0906	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.9
第2計算期間	10.8
2018年6月16日～ 2018年12月15日	6.8

(参考) マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(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		32,507,261,006	91.62
	内 香港	468,864,887	1.32
	内 シンガポール	162,054,594	0.46
	内 イスラエル	72,420,348	0.20
	内 ノルウェー	94,553,723	0.27
	内 スウェーデン	349,151,818	0.98
	内 デンマーク	231,938,715	0.65
	内 イギリス	2,101,813,827	5.92
	内 アイルランド	68,086,748	0.19
	内 オランダ	431,685,652	1.22
	内 ベルギー	118,237,990	0.33
	内 フランス	1,335,903,374	3.77
	内 ドイツ	1,103,117,139	3.11
	内 スイス	1,076,775,355	3.03
	内 ポルトガル	20,131,944	0.06
	内 スペイン	386,167,108	1.09
	内 イタリア	283,965,644	0.80
	内 フィンランド	132,544,615	0.37
	内 オーストリア	27,293,424	0.08
	内 カナダ	1,175,068,247	3.31
	内 アメリカ	22,064,675,753	62.19
	内 オーストラリア	771,169,120	2.17
	内 ニュージーランド	31,640,981	0.09
投資証券		904,275,449	2.55
	内 香港	38,146,469	0.11
	内 シンガポール	15,801,885	0.04
	内 イギリス	19,889,734	0.06
	内 フランス	40,802,541	0.11
	内 カナダ	6,038,186	0.02
	内 アメリカ	693,310,098	1.95
	内 オーストラリア	90,286,536	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,069,300,183	5.83
純資産総額		35,480,836,638	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)	908,818,617	2.56
内 イギリス	73,370,686	0.21

内 ドイツ	199,614,356	0.56
内 カナダ	69,218,632	0.20
内 アメリカ	512,348,250	1.44
内 オーストラリア	54,266,693	0.15
為替予約取引(売建)	37,125,076,115	104.63
内 日本	37,125,076,115	104.63

(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。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

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



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

	直近1年間分配金合計額: 0円		設定来分配金合計額: 0円	
決算期	第1期	第2期		
	17年6月	18年6月		
分配金	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	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,243	94.2%	日本円	108.8%	金融	15.6%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
外国リート	62	2.4%	ニュージーランド・ドル	0.0%	情報技術	14.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
外国投資証券	6	0.1%	イスラエル・シケル	-0.0%	ヘルスケア	13.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.8%
			シンガポール・ドル	-0.0%	資本財・サービス	9.3%	S&P500 EMINI FUT 201903	アメリカ	1.4%
コール・ローン、その他		5.8%	香港ドル	-0.0%	一般消費財・サービス	9.0%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
合計	1,311	-	ノルウェー・クローネ	-0.0%	生活必需品	8.2%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			デンマーク・クローネ	-0.0%	コミュニケーション・サービス	7.9%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
アメリカ		65.6%	豪ドル	-0.1%	エネルギー	6.0%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.0%
イギリス		6.2%	スウェーデン・クローネ	-0.1%	素材	4.1%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
その他		25.0%	その他	-8.6%	公益事業、他	4.0%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
合計		96.7%	合計	100.0%	合計	91.6%	合計		13.3%

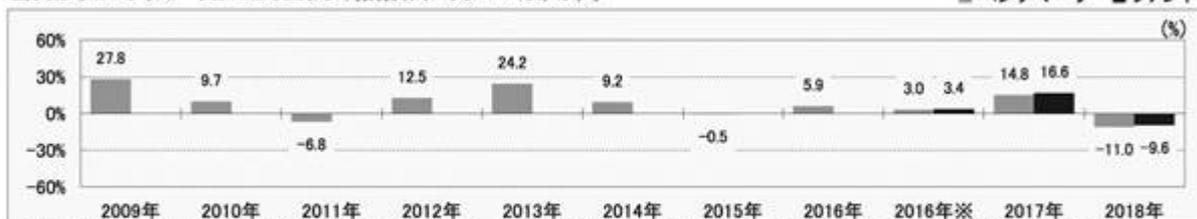
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)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。

*2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【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) 【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	3,359,982,982	99.99
内 日本	3,359,982,982	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	226,725	0.01
純資産総額	3,360,209,707	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6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
2017年12月末日	2,455,481,858	-	1.3873	-
2018年1月末日	2,607,276,740	-	1.4023	-
2月末日	2,690,517,552	-	1.3387	-
3月末日	2,896,982,397	-	1.2815	-
4月末日	3,062,274,429	-	1.3382	-
5月末日	3,206,747,800	-	1.3442	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
6月末日	3,203,005,075	-	1.3544	-
7月末日	3,320,769,257	-	1.4075	-
8月末日	3,512,126,581	-	1.4374	-

9月末日	3,715,830,092	-	1.4733	-
10月末日	3,464,689,500	-	1.3430	-
11月末日	3,648,009,194	-	1.3737	-
12月末日	3,360,209,707	-	1.2300	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.3
第2計算期間	13.9
2018年6月16日～ 2018年12月15日	4.2

(参考) マザーファンド

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。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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	12,300円
純資産総額	33億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-10.5%
3か月間	-16.5%
6か月間	-9.2%
1年間	-11.3%
3年間	-
5年間	-
設定来	23.0%

※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運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期		第2期		第3期		第4期		第5期	
	17年6月	18年6月								
分配金	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	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,244	97.4%	米ドル	68.2%	金融	16.4%	APPLE INC	アメリカ	2.3%
外国リート	63	2.6%	ユーロ	11.8%	情報技術	15.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
外国投資証券	6	0.1%	英ポンド	6.4%	ヘルスケア	13.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.8%
			カナダ・ドル	3.6%	資本財・サービス	9.8%	S&P500 EMINI FUT 201903	アメリカ	1.2%
コール・ローン、その他		1.1%	スイス・フラン	3.3%	一般消費財・サービス	9.4%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
合計	1,313	-	豪ドル	2.7%	生活必需品	8.6%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			香港ドル	1.4%	コミュニケーション・サービス	8.3%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
アメリカ		67.9%	スウェーデン・クローネ	1.0%	エネルギー	6.3%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.0%
イギリス		6.4%	デンマーク・クローネ	0.7%	素材	4.5%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.0%
その他		25.8%	その他	0.9%	公益事業、他	4.1%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	96.2%	合計		13.4%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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MSCIコクサイ指数(円ベース)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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【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)】

(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	1,527,127,842	99.19
内 日本	1,527,127,842	99.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,525,092	0.81
純資産総額	1,539,652,934	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6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
2017年12月末日	1,382,683,301	-	1.3867	-
2018年1月末日	1,507,636,494	-	1.4170	-
2月末日	1,550,169,409	-	1.3567	-
3月末日	1,535,216,957	-	1.2984	-
4月末日	1,611,972,688	-	1.3448	-
5月末日	1,632,975,733	-	1.3365	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
6月末日	1,632,570,964	-	1.3333	-
7月末日	1,737,294,421	-	1.3950	-
8月末日	1,742,861,067	-	1.4089	-
9月末日	1,794,972,436	-	1.4492	-
10月末日	1,666,837,191	-	1.3281	-
11月末日	1,701,761,500	-	1.3628	-
12月末日	1,539,652,934	-	1.2319	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第1計算期間	21.6
第2計算期間	13.3
2018年6月16日～ 2018年12月15日	3.6

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

前記「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)」の記載と同じ。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (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	4,862,965,075	82.22
内 中国	1,510,216,137	25.53
内 台湾	730,310,958	12.35
内 タイ	193,830,794	3.28
内 シンガポール	3,211,650	0.05
内 マレーシア	120,251,835	2.03
内 インドネシア	88,785,390	1.50
内 インド	381,966,615	6.46
内 ポーランド	74,340,594	1.26
内 ロシア	454,322,553	7.68
内 トルコ	65,405,488	1.11
内 メキシコ	181,316,188	3.07
内 チリ	54,335,044	0.92
内 ブラジル	708,881,860	11.99
内 南アフリカ	295,789,969	5.00
投資証券	939,107,329	15.88
内 アメリカ	922,626,450	15.60
内 メキシコ	5,714,561	0.10
内 南アフリカ	10,766,318	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	112,487,108	1.90
純資産総額	5,914,559,512	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)	53,379,900	0.90
内 アメリカ	53,379,900	0.90
為替予約取引(買建)	11,026,000	0.19
内 日本	11,026,000	0.19

(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。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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



※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)

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6月	第2期 18年6月		
分配金	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。

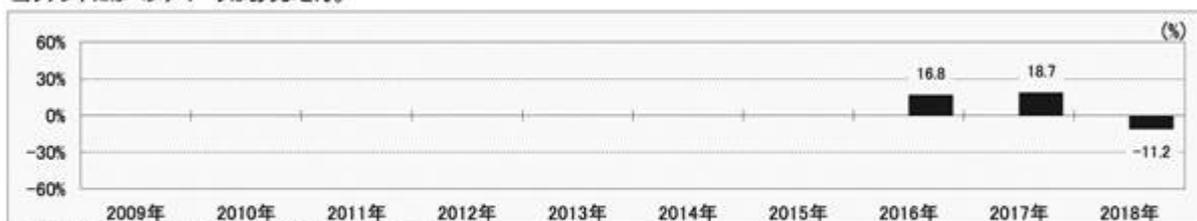
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,599	93.6%	米ドル	58.7%	金融	18.3%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	3.2%
外国投資証券	7	3.3%	ユーロ	9.3%	情報技術	13.8%	APPLE INC	アメリカ	1.8%
外国リート	66	2.1%	香港ドル	6.2%	ヘルスケア	10.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.8%
			英ポンド	5.1%	エネルギー	8.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.4%
コール・ローン、その他		2.1%	カナダ・ドル	2.9%	資本財・サービス	8.2%	S&P500 EMINI FUT 201903	アメリカ	0.9%
合計	1,872	-	スイス・フラン	2.6%	コミュニケーション・サービス	8.1%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
国・地域別構成			台湾ドル	2.5%	一般消費財・サービス	8.0%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.8%
アメリカ		56.8%	ブラジル・レアル	2.5%	生活必需品	7.6%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
中国		5.3%	豪ドル	2.1%	素材	5.2%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	0.8%
その他		37.0%	その他	8.1%	公益事業、他	4.2%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.8%
合計		99.0%	合計	100.0%	合計	92.5%	合計		13.0%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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26日)から年末、2018年は12月28日までの騰落率を表しています。

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

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(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	25,945,844,438	99.90
内 日本	25,945,844,438	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	25,814,630	0.10
純資産総額	25,971,659,068	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6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
2017年12月末日	20,904,581,317	-	0.9869	-
2018年1月末日	20,910,522,589	-	0.9851	-
2月末日	21,783,029,193	-	0.9888	-
3月末日	23,761,768,234	-	0.9902	-
4月末日	24,748,449,763	-	0.9893	-
5月末日	24,673,148,000	-	0.9914	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
6月末日	25,049,241,203	-	0.9918	-
7月末日	25,753,044,616	-	0.9899	-
8月末日	26,054,836,052	-	0.9844	-

9月末日	26,263,662,200	-	0.9820	-
10月末日	26,883,863,787	-	0.9835	-
11月末日	26,871,559,556	-	0.9875	-
12月末日	25,971,659,068	-	0.9947	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.4
第2計算期間	0.6
2018年6月16日～ 2018年12月15日	0.1

(参考) マザーファンド

日本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	66,117,235,190	85.36
内 日本	66,117,235,190	85.36
地方債証券	4,316,294,700	5.57
内 日本	4,316,294,700	5.57
特殊債券	3,334,874,300	4.31
内 日本	3,334,874,300	4.31
社債券	3,413,255,500	4.41
内 日本	3,413,255,500	4.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	276,269,859	0.36
純資産総額	77,457,929,549	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

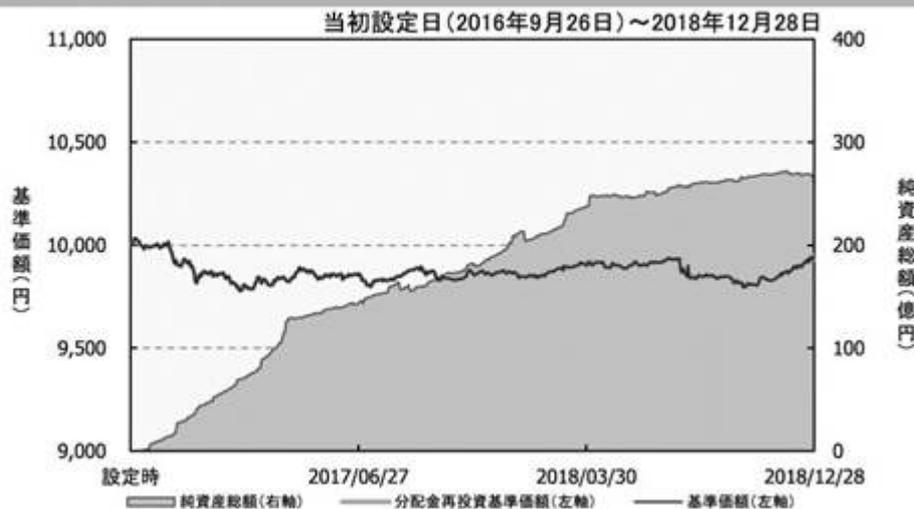
●FW 日本債券インデックス

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	9,947円
純資産総額	259億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	0.7%
3か月間	1.3%
6か月間	0.3%
1年間	0.8%
3年間	-
5年間	-
設定来	-0.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

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

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	356	99.5%	直接利回り(%)	124 5年国債	0.100	2020/06/20	1.7%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	129 5年国債	0.100	2021/09/20	1.3%	
コール・ローン、その他		0.5%	修正デュレーション	128 5年国債	0.100	2021/06/20	1.3%	
合計	356	100.0%	残存年数	127 5年国債	0.100	2021/03/20	1.3%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率	135 5年国債	0.100	2023/03/20	1.2%
国債		85.1%	AAA	88.6%	125 5年国債	0.100	2020/09/20	1.2%
地方債		6.9%	AA	5.4%	131 5年国債	0.100	2022/03/20	1.2%
事業債		4.5%	A	3.4%	130 5年国債	0.100	2021/12/20	1.1%
政府保証債		2.4%	BBB	-	342 10年国債	0.100	2026/03/20	1.1%
その他		0.5%	BB以下・無格付	2.6%	343 10年国債	0.100	2026/06/20	1.1%
合計		99.5%	合計	100.0%	合計			12.6%

※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2.6%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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数です。

■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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

(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	68,337,496,078	99.91
内 日本	68,337,496,078	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	61,764,777	0.09
純資産総額	68,399,260,855	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6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
2017年12月末日	49,909,235,352	-	0.9622	-
2018年1月末日	51,568,060,532	-	0.9513	-
2月末日	53,702,097,975	-	0.9474	-
3月末日	58,474,056,538	-	0.9600	-
4月末日	59,576,531,775	-	0.9503	-
5月末日	60,047,201,359	-	0.9490	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
6月末日	61,805,029,806	-	0.9519	-
7月末日	63,587,647,536	-	0.9471	-
8月末日	65,158,512,283	-	0.9482	-
9月末日	66,114,557,844	-	0.9418	-
10月末日	67,165,099,798	-	0.9390	-
11月末日	67,961,614,159	-	0.9417	-
12月末日	68,399,260,855	-	0.9542	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第1計算期間	2.9
第2計算期間	2.4
2018年6月16日～ 2018年12月15日	0.1

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり) 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	77,706,995,850	94.37
内 ユーロ	30,091,068,762	36.54
内 シンガポール	306,740,107	0.37
内 マレーシア	273,508,046	0.33
内 ノルウェー	177,629,501	0.22
内 スウェーデン	258,220,036	0.31
内 デンマーク	418,410,456	0.51
内 イギリス	5,282,768,875	6.42
内 ポーランド	460,701,049	0.56
内 カナダ	1,641,720,032	1.99
内 アメリカ	36,222,060,212	43.99
内 メキシコ	522,929,792	0.64
内 南アフリカ	386,986,986	0.47
内 オーストラリア	1,664,251,996	2.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,636,385,835	5.63
純資産総額	82,343,381,685	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(売建)	79,253,844,620	96.25
内 日本	79,253,844,620	96.25

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

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

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

(参考情報) 運用実績

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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	9,542円
純資産総額	683億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	1.3%
6カ月間	0.2%
1年間	-0.8%
3年間	-
5年間	-
設定来	-4.6%

※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	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6月	第2期 18年6月		
分配金	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10銘柄	償還日	比率
外国債券	406	94.3%	日本円	98.4%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2020/11/15	4.4%
			米ドル	1.0%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2020/06/30	3.7%
コール・ローン、その他		5.7%	ユーロ	0.3%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2021/11/15	2.5%
合計	406	100.0%	英ポンド	0.2%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2022/09/30	2.2%
			カナダ・ドル	0.1%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2022/02/28	2.0%
債券種別構成			豪ドル	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2021/06/30	1.9%
国債		94.3%	メキシコ・ペソ	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	1.8%
			マレーシア・リンギット	0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.6%
			シンガポール・ドル	0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	1.6%
			その他	0.0%	BB	United States Treasury Note/Bond	2023/05/15	1.4%
合計		94.3%	合計	100.0%	合計	合計		23.0%

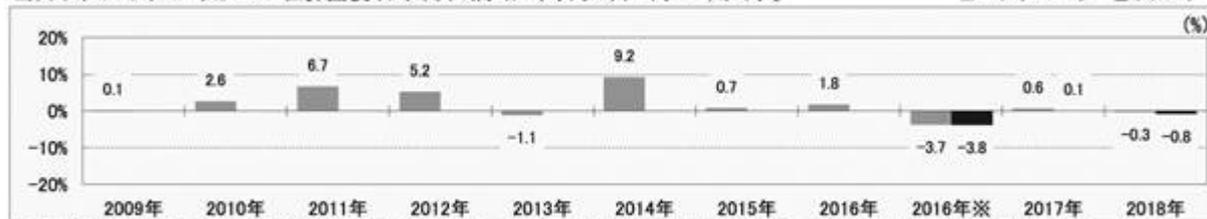
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【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)】

(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	3,100,377,218	99.90
内 日本	3,100,377,218	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,143,282	0.10
純資産総額	3,103,520,500	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6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
2017年12月末日	1,686,946,765	-	1.1240	-
2018年1月末日	1,770,402,634	-	1.0959	-
2月末日	1,890,939,350	-	1.0674	-
3月末日	2,242,875,510	-	1.0742	-
4月末日	2,282,578,266	-	1.0868	-
5月末日	2,332,276,541	-	1.0585	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
6月末日	2,445,384,573	-	1.0738	-
7月末日	2,491,095,217	-	1.0814	-
8月末日	2,625,744,114	-	1.0804	-
9月末日	2,788,039,530	-	1.0980	-
10月末日	2,830,307,725	-	1.0777	-
11月末日	2,977,278,667	-	1.0871	-
12月末日	3,103,520,500	-	1.0799	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第1計算期間	6.2
第2計算期間	0.8
2018年6月16日～ 2018年12月15日	2.2

(参考) マザーファンド

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

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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	10,799円
純資産総額	31億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-0.7%
3か月間	-1.6%
6か月間	0.6%
1年間	-3.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	8.0%

※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	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6月	第2期 18年6月		
分配金	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10銘柄	償還日	比率
外国債券	761	98.5%	米ドル	45.9%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2028/02/15	0.4%
			ユーロ	39.4%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2022/11/30	0.4%
			英ポンド	6.5%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.4%
コール・ローン、その他		1.5%	豪ドル	2.1%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	0.4%
合計	761	100.0%	カナダ・ドル	2.0%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.8%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	0.4%
債券種別構成		98.5%	ポーランド・ズロチ	0.6%	AA	FRENCH GOVERNMENT BOND	2023/10/25	0.4%
国債			南アフリカ・ランド	0.6%	A	FRENCH GOVERNMENT BOND	2041/04/25	0.4%
			デンマーク・クローネ	0.5%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	0.4%
			その他	1.5%	BB	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%
合計		98.5%	合計	100.0%	合計	合計		3.8%

※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。

※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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【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)】

(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	1,227,726,418	99.91
内 日本	1,227,726,418	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,126,418	0.09
純資産総額	1,228,852,836	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6月15日)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
2017年12月末日	973,450,769	-	1.1361	-
2018年1月末日	1,047,119,678	-	1.1137	-
2月末日	1,095,923,936	-	1.0875	-
3月末日	1,160,703,933	-	1.0924	-
4月末日	1,187,131,102	-	1.1018	-
5月末日	1,183,454,685	-	1.0671	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
6月末日	1,193,345,610	-	1.0748	-
7月末日	1,220,096,206	-	1.0876	-
8月末日	1,218,764,262	-	1.0724	-
9月末日	1,244,662,824	-	1.0966	-
10月末日	1,254,438,742	-	1.0767	-
11月末日	1,265,239,779	-	1.0906	-
12月末日	1,228,852,836	-	1.0806	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第1計算期間	7.5
第2計算期間	0.0
2018年6月16日～ 2018年12月15日	2.0

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「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)」の記載と同じ。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (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	10,233,604,659	95.96
内 タイ	892,539,411	8.37
内 マレーシア	591,924,495	5.55
内 フィリピン	31,217,028	0.29
内 インドネシア	955,596,619	8.96
内 ポーランド	977,515,224	9.17
内 ロシア	702,847,701	6.59
内 ハンガリー	492,424,728	4.62
内 ルーマニア	317,641,033	2.98
内 トルコ	506,664,551	4.75
内 チェコ	418,247,084	3.92
内 メキシコ	1,055,943,050	9.90
内 コロンビア	733,976,214	6.88
内 ベルギー	291,323,980	2.73
内 チリ	310,079,621	2.91
内 ブラジル	1,049,680,823	9.84
内 ウルグアイ	26,275,981	0.25
内 アルゼンチン	51,901,148	0.49
内 南アフリカ	827,805,968	7.76
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	431,027,928	4.04
純資産総額	10,664,632,587	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)	105,049,947	0.99
内 日本	105,049,947	0.99

(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

●FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月							
分配金	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。

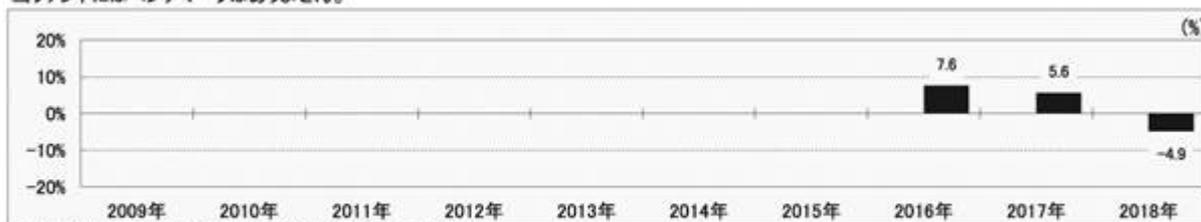
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	911	98.0%	米ドル	36.7%	直接利回り(%)	Brazil Letras do Tesouro Nacional	2020/07/01	0.5%
			ユーロ	31.5%	最終利回り(%)	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.4%
			英ポンド	5.2%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2028/02/15	0.3%
			メキシコ・ペソ	2.7%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2022/11/30	0.3%
債券種類構成			ポーランド・ズロチ	2.4%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.3%
国債		98.0%	南アフリカ・ランド	2.1%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	0.3%
			ブラジル・レアル	2.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	1.9%	A	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	0.3%
			タイ・バーツ	1.7%	BBB	FRENCH GOVERNMENT BOND	2023/10/25	0.3%
			その他	13.7%	BB以下	FRENCH GOVERNMENT BOND	2041/04/25	0.3%
合計		98.0%	合計	100.0%	合計	合計		3.3%

※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。

※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。

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26日)から年末、2018年は12月28日までの騰落率を表しています。

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

【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

(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	2,632,836,512	99.80
内 日本	2,632,836,512	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,233,577	0.20
純資産総額	2,638,070,089	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6月15日)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
2017年12月末日	1,922,250,850	-	0.9631	-
2018年1月末日	2,107,302,583	-	1.0133	-
2月末日	2,159,864,763	-	0.9932	-
3月末日	2,229,280,413	-	0.9880	-
4月末日	2,303,243,243	-	1.0132	-
5月末日	2,335,805,252	-	1.0195	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
6月末日	2,390,945,118	-	1.0407	-
7月末日	2,437,593,812	-	1.0458	-
8月末日	2,452,019,523	-	1.0422	-
9月末日	2,538,713,720	-	1.0586	-

10月末日	2,573,744,365	-	1.0422	-
11月末日	2,695,747,355	-	1.0870	-
12月末日	2,638,070,089	-	1.0667	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.5
2018年6月16日～ 2018年12月15日	6.1

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REIT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(%)
投資証券	220,023,915,600	98.45
内 日本	220,023,915,600	98.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,473,965,617	1.55
純資産総額	223,497,881,217	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,159,000,000	1.41
内 日本	3,159,000,000	1.41

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

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

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

(参考情報) 運用実績

●FW J-REITインデックス

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	10,667円
純資産総額	26億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-1.9%
3か月間	0.8%
6か月間	2.5%
1年間	10.8%
3年間	-
5年間	-
設定来	6.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	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6月	第2期 18年6月		
分配金	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	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	98.3%	オフィス不動産	33.0%	日本ビルファンド	オフィス不動産	7.6%
国内リート先物	1	1.4%	各種不動産	28.2%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	7.0%
			工業用不動産	11.9%	野村不動産マスターF	各種不動産	4.9%
			店舗用不動産	9.9%	日本リテールファンド	店舗用不動産	4.7%
			住宅用不動産	9.0%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	4.3%
			ホテル・リゾート不動産	6.0%	オリックス不動産投資	オフィス不動産	4.1%
			ヘルスケア不動産	0.3%	日本プロジスリート	工業用不動産	3.5%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産	3.5%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.3%
コール・ローン、その他		1.7%			GLP投資法人	工業用不動産	3.1%
合計	62	-	合計	98.3%	合計		46.0%

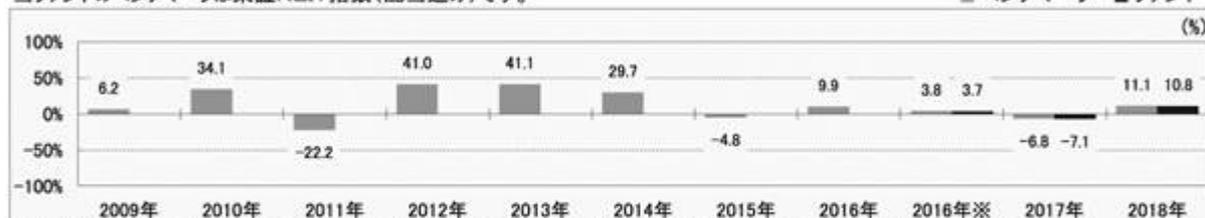
※リート用途別構成の用途は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

(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	8,956,614,531	97.42
内 日本	8,956,614,531	97.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	237,267,141	2.58
純資産総額	9,193,881,672	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(売建)	9,554,144,150	103.92
内 日本	9,554,144,150	103.92

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

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

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

(2) 【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6月15日)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844
2017年12月末日	7,437,388,311	-	0.9934	-
2018年1月末日	7,444,393,767	-	0.9433	-
2月末日	7,447,011,816	-	0.8953	-
3月末日	7,931,101,956	-	0.9191	-
4月末日	8,045,412,640	-	0.9213	-
5月末日	8,572,150,181	-	0.9658	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
6月末日	8,921,950,710	-	0.9912	-
7月末日	8,944,068,023	-	0.9864	-
8月末日	9,473,015,676	-	1.0175	-
9月末日	9,367,848,517	-	0.9797	-
10月末日	9,483,218,756	-	0.9708	-
11月末日	9,827,932,293	-	0.9869	-
12月末日	9,193,881,672	-	0.9214	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.6
第2計算期間	1.2
2018年6月16日～ 2018年12月15日	0.8

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (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(%)
投資信託受益証券	156,340,170	0.86
内 アメリカ	156,340,170	0.86
投資証券	17,805,605,388	98.19
内 ガーンジー	23,605,511	0.13
内 マン島	7,997,434	0.04
内 香港	429,896,052	2.37
内 シンガポール	692,961,127	3.82
内 イスラエル	3,714,839	0.02
内 イギリス	879,933,875	4.85
内 アイルランド	41,827,338	0.23
内 オランダ	61,250,183	0.34
内 ベルギー	158,193,918	0.87
内 フランス	756,675,602	4.17
内 ドイツ	49,843,487	0.27
内 スペイン	132,572,356	0.73
内 イタリア	16,562,397	0.09
内 カナダ	332,909,489	1.84
内 アメリカ	12,841,808,984	70.82
内 オーストラリア	1,294,102,530	7.14
内 ニューージーランド	81,750,266	0.45

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	171,405,300	0.95
純資産総額	18,133,350,858	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	117,636,100	0.65
内 ドイツ	19,634,200	0.11
内 アメリカ	98,001,900	0.54
為替予約取引(買建)	12,131,400	0.07
内 日本	12,131,400	0.07

(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

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

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



分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月								
分配金	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。

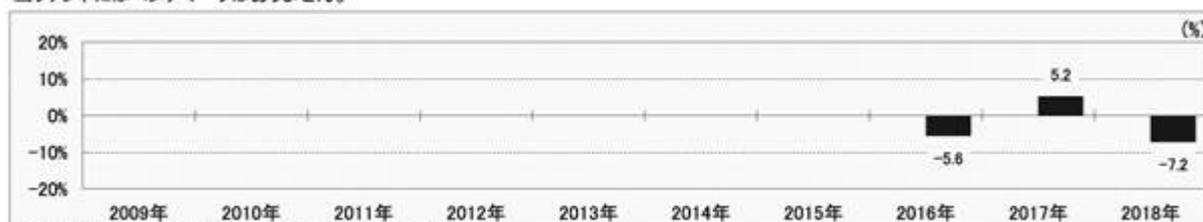
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	307	96.2%	日本円	106.8%	商業施設	23.7%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	4.8%
外国投資信託等	2	0.9%	香港ドル	0.1%	住宅	13.7%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.4%
コール・ローン、その他		3.5%	シンガポール・ドル	0.1%	オフィス	12.1%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.8%
合計	309	-	ニュージーランド・ドル	-0.0%	各種不動産	11.0%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成		比率	イスラエル・シケル	-0.0%	ヘルスケア	9.7%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.2%
アメリカ		70.4%	カナダ・ドル	-0.0%	産業施設	9.4%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.2%
オーストラリア		7.0%	豪ドル	-0.1%	貸倉庫	6.1%	LINK REIT	商業施設	香港	2.0%
イギリス		4.7%	英ポンド	-0.3%	特殊用途施設	5.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.0%
フランス		4.1%	ユーロ	-0.6%	ホテル/リゾート	4.4%	VENTAS INC	ヘルスケア	アメリカ	1.9%
その他		11.0%	米ドル	-5.9%			UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	商業施設	フランス	1.9%
合計		97.1%	合計	100.0%	合計	95.6%	合計			25.7%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

*2016年は設定日(9月26日)から年末、2018年は12月28日までの騰落率を表しています。

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

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

(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	1,272,735,725	99.96
内 日本	1,272,735,725	99.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	452,710	0.04
純資産総額	1,273,188,435	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6月15日)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
2017年12月末日	991,049,267	-	1.1362	-
2018年1月末日	971,283,647	-	1.0497	-
2月末日	974,529,600	-	0.9772	-
3月末日	1,046,385,249	-	0.9942	-
4月末日	1,090,049,358	-	1.0235	-
5月末日	1,154,094,428	-	1.0620	-
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
6月末日	1,208,428,126	-	1.1039	-
7月末日	1,233,132,500	-	1.1078	-
8月末日	1,301,574,617	-	1.1425	-
9月末日	1,316,967,606	-	1.1272	-
10月末日	1,346,801,678	-	1.1102	-
11月末日	1,392,556,471	-	1.1361	-
12月末日	1,273,188,435	-	1.0354	-

【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
2018年6月16日～ 2018年12月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.3
第2計算期間	1.3
2018年6月16日～ 2018年12月15日	3.9

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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	10,354円
純資産総額	12億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-8.9%
3カ月間	-8.1%
6カ月間	-6.2%
1年間	-8.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	3.5%

※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	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6月	第2期 18年6月		
分配金	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	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	307	98.7%	米ドル	72.2%	商業施設	24.3%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	4.9%
外国投資信託等	2	0.9%	豪ドル	7.2%	住宅	14.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.4%
コール・ローン、その他		1.0%	ユーロ	6.8%	オフィス	12.5%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.9%
合計	309	-	英ポンド	5.1%	各種不動産	11.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.5%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.6%	ヘルスケア	9.9%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.3%
アメリカ		72.2%	香港ドル	2.6%	産業施設	9.6%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.3%
オーストラリア		7.1%	カナダ・ドル	1.9%	貸倉庫	6.2%	LINK REIT	商業施設	香港	2.1%
イギリス		4.9%	ニュージーランド・ドル	0.5%	特殊用途施設	5.7%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.0%
フランス		4.2%	日本円	0.3%	ホテル/リゾート	4.6%	VENTAS INC	ヘルスケア	アメリカ	2.0%
その他		11.3%	イスラエル・シケル	0.0%			UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	商業施設	フランス	2.0%
合計		99.7%	合計	100.0%	合計	98.1%	合計			26.3%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	4,454,641,067	310,563,294
第2計算期間	4,087,459,929	1,994,650,943
2018年6月16日～ 2018年12月15日	1,455,606,763	710,551,607

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,867,193,216	117,139,415
第2計算期間	2,980,382,583	1,019,368,476
2018年6月16日～ 2018年12月15日	1,052,999,617	786,849,950

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
2018年6月16日～ 2018年12月15日	5,653,858,357	3,171,629,823

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

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)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,475,674,063	70,680,538
第2計算期間	1,380,206,909	412,026,062
2018年6月16日～ 2018年12月15日	625,606,516	320,266,227

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

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)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	702,644,049	33,190,572

第2計算期間	695,338,362	142,407,106
2018年6月16日～ 2018年12月15日	182,459,492	160,802,183

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	15,709,737,796	1,257,184,902
第2計算期間	17,894,969,975	7,012,636,355
2018年6月16日～ 2018年12月15日	5,130,878,877	3,347,241,743

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	37,021,440,339	2,368,454,114
第2計算期間	41,568,085,908	11,780,237,725
2018年6月16日～ 2018年12月15日	14,950,157,198	7,695,828,317

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

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)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,394,396,399	72,737,713
第2計算期間	1,454,615,593	530,660,407
2018年6月16日～ 2018年12月15日	862,116,378	251,790,339

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

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)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	571,935,222	15,390,972
第2計算期間	683,181,594	128,182,978
2018年6月16日～ 2018年12月15日	174,385,375	149,262,330

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

ダイワファンドラップ J-REITインデックス

	設定数量(口)	解約数量(口)

第1計算期間	1,295,129,456	60,344,463
第2計算期間	1,366,263,589	304,124,518
2018年6月16日～ 2018年12月15日	469,188,299	278,049,050

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,609,575,520	250,487,506
第2計算期間	4,660,565,456	1,092,724,304
2018年6月16日～ 2018年12月15日	1,993,634,373	984,633,897

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	593,727,416	35,333,000
第2計算期間	637,956,340	111,827,964
2018年6月16日～ 2018年12月15日	261,478,107	129,462,412

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

3 【ファンドの経理状況】

【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	175,127	24,715,615
コール・ローン	15,945,816	19,611,126
親投資信託受益証券	8,561,785,181	8,571,110,270
未収入金	3,221,000	-
流動資産合計	8,581,127,124	8,615,437,011
資産合計	8,581,127,124	8,615,437,011
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,545,147	5,612,537
未払受託者報酬	843,000	953,120
未払委託者報酬	12,224,330	13,820,946
未払利息	-	46
その他未払費用	210,914	238,479
流動負債合計	18,823,391	20,625,128
負債合計	18,823,391	20,625,128
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,237,886,759	1 6,982,941,915
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,324,416,974	1,611,869,968
(分配準備積立金)	843,028,662	758,091,289
元本等合計	8,562,303,733	8,594,811,883
純資産合計	8,562,303,733	8,594,811,883
負債純資産合計	8,581,127,124	8,615,437,011

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		17
有価証券売買等損益		764,252,593		933,522,911
営業収益合計		764,252,593		933,522,894
営業費用				
支払利息		3,529		6,120
受託者報酬		624,078		953,120
委託者報酬		9,049,816		13,820,946
その他費用		155,941		239,295
営業費用合計		9,833,364		15,019,481
営業利益又は営業損失()		754,419,229		948,542,375
経常利益又は経常損失()		754,419,229		948,542,375
中間純利益又は中間純損失()		754,419,229		948,542,375
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()		69,370,886		28,827,707
期首剰余金又は期首欠損金()		814,251,074		2,324,416,974
剰余金増加額又は欠損金減少額		528,553,873		468,234,836
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		528,553,873		468,234,836
剰余金減少額又は欠損金増加額		224,763,575		261,067,174
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		224,763,575		261,067,174
中間剰余金又は中間欠損金()		1,803,089,715		1,611,869,968

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	4,145,077,773円	6,237,886,759円
期中追加設定元本額	4,087,459,929円	1,455,606,763円
期中一部解約元本額	1,994,650,943円	710,551,607円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	6,237,886,759口	6,982,941,915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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3726円 (13,726円)	1,2308円 (12,308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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	120,882,976	922,366,704
コール・ローン	11,006,764,790	13,707,924,427
株式 2 3	144,768,159,960	135,327,737,080
派生商品評価勘定	265,140	-
未収入金	5,045,609	26,730,000
未収配当金	948,984,720	18,603,800

未収利息		368,056	595,703
前払金		7,485,000	-
その他未収収益	4	17,292,950	4,682,172
流動資産合計		156,875,249,201	150,008,639,886
資産合計		156,875,249,201	150,008,639,886
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		49,680	12,440,780
前受金		-	480,000
未払金		693,489,959	-
未払解約金		129,332,800	24,152,100
未払利息		-	32,606
受入担保金		9,421,551,195	13,839,092,725
その他未払費用		145,460	248,986
流動負債合計		10,244,569,094	13,876,447,197
負債合計		10,244,569,094	13,876,447,197
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,458,954,190	134,843,033,378
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		16,171,725,917	1,289,159,311
元本等合計		146,630,680,107	136,132,192,689
純資産合計		146,630,680,107	136,132,192,689
負債純資産合計		156,875,249,201	150,008,639,886

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	134,029,657,083円	130,458,954,190円
期中追加設定元本額	16,293,172,951円	9,408,800,967円
期中一部解約元本額	19,863,875,844円	5,024,721,779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	4,153,396,880円	4,191,311,836円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	9,718,686,101円	8,727,309,822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VA2	61,521,904円	50,880,402円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(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50VA(一般投資家私 募)	1,168,663,058円	1,048,156,296円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,978,575円	59,055,392円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,610,026,616円	1,439,586,422円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	4,609,187円
D-I's TOPIXイン デックス	27,076,578円	40,050,488円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,422,329円	19,159,387円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	637,974円	687,039円
iFree TOPIXイン デックス	501,844,025円	798,765,823円
iFree 8資産バランス	876,329,679円	1,313,421,357円
iFree 年金バランス	- 円	19,858,640円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,933,028,590円	65,579,505,949円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,334,930,943円	2,619,313,324円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,510,392,046円	2,915,921,593円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,438,475,706円	2,819,581,006円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,407,980,880円	4,616,848,896円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,753,126円	15,108,787円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	48,545,108円	52,628,034円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,282,313円	16,816,766円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	13,188,791円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	334,996円	350,718円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	343,410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)	684,622円	712,052円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	2,185,320円	4,149,572円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,842,830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)	10,343,078円	9,756,807円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	234,779,386円	184,088,109円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	164,962,864円	161,522,359円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,950,968,666円	9,663,609,360円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	50,169,076円	11,266,082円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	44,279,094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)	858,675,952円	825,057,420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	102,672,198円	143,506,346円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,617,246,603円	8,489,610,014円

	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	89,512,504円	305,054,109円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,719,661,688円	1,912,788,655円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,348,424,482円	1,392,797,982円
	ダイワライフスタイル25	174,040,116円	181,391,040円
	ダイワライフスタイル50	615,588,461円	650,123,689円
	ダイワライフスタイル75	519,964,237円	543,075,669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)	13,621,969,928円	13,566,779,726円
	計	130,458,954,190円	134,843,033,378円
2.	期末日における受益権の総数	130,458,954,190口	134,843,033,378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 8,912,218,000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 13,069,709,110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 756,200,000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 682,900,000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16,490,162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3,399,225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15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15日 現在				平成30年12月15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	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000	916,430,000	-	904,020,000	12,410,000
合計	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000	916,430,000	-	904,020,000	12,410,000

（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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.1240円	1.0096円
（1万口当たり純資産額）	（11,240円）	（10,096円）

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	27,395,062	20,936,097
親投資信託受益証券	6,622,436,669	6,592,119,628
未収入金	65,230,000	10,920,000
流動資産合計	6,715,061,731	6,623,975,725
資産合計	6,715,061,731	6,623,975,725
負債の部		
流動負債		
未払解約金	81,703,992	15,242,766
未払受託者報酬	622,279	714,675
未払委託者報酬	9,023,568	10,363,367
その他未払費用	156,099	180,066
流動負債合計	91,505,938	26,500,874
負債合計	91,505,938	26,500,874
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,712,067,908	1 4,978,217,575
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,911,487,885	1,619,257,276
(分配準備積立金)	787,561,755	666,643,549
元本等合計	6,623,555,793	6,597,474,851
純資産合計	6,623,555,793	6,597,474,851
負債純資産合計	6,715,061,731	6,623,975,725

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自	平成30年6月16日 至 平成30年12月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		592,954,552		370,977,041
営業収益合計		592,954,552		370,977,041
営業費用				
支払利息		2,784		3,239
受託者報酬		439,038		714,675
委託者報酬		6,366,619		10,363,367
その他費用		109,670		182,733
営業費用合計		6,918,111		11,264,014
営業利益又は営業損失()		586,036,441		382,241,055
経常利益又は経常損失()		586,036,441		382,241,055
中間純利益又は中間純損失()		586,036,441		382,241,055
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		49,160,227		3,109,721
期首剰余金又は期首欠損金()		552,144,137		1,911,487,885
剰余金増加額又は欠損金減少額		351,642,389		411,503,904
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		351,642,389		411,503,904
剰余金減少額又は欠損金増加額		108,252,459		318,383,737
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		108,252,459		318,383,737
中間剰余金又は中間欠損金()		1,332,410,281		1,619,257,276

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	2,751,053,801円	4,712,067,908円
期中追加設定元本額	2,980,382,583円	1,052,999,617円
期中一部解約元本額	1,019,368,476円	786,849,950円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	4,712,067,908口	4,978,217,575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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4057円 (14,057円)	1,3253円 (13,253円)

(参考)

当ファンドは、「ストックインデックス225・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。

「ストックインデックス225・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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,389,088,942	3,695,125,281
株式	2 152,731,980,480	165,013,680,260
派生商品評価勘定	32,827,900	26,407,104
未収入金	1,228,693,438	-
未収配当金	837,754,912	984,000
流動資産合計	156,220,345,672	168,736,196,645

資産合計		156,220,345,672	168,736,196,645
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		21,080	5,288,100
前受金		19,860,000	74,220,000
未払金		-	1,168,909,097
未払解約金		802,354,200	67,200,000
その他未払費用		103,114	264,840
流動負債合計		822,338,394	1,315,882,037
負債合計		822,338,394	1,315,882,037
純資産の部			
元本等			
元本	1	55,624,307,757	63,456,344,619
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		99,773,699,521	103,963,969,989
元本等合計		155,398,007,278	167,420,314,608
純資産合計		155,398,007,278	167,420,314,608
負債純資産合計		156,220,345,672	168,736,196,645

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>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。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	57,587,549,837円	55,624,307,757円
期中追加設定元本額	13,183,390,233円	13,424,357,448円
期中一部解約元本額	15,146,632,313円	5,592,320,586円
2. 期末日における受益権の総数	55,624,307,757口	63,456,344,619口

3. 2 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 2,437,650,000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 2,529,300,000円
--------------------	---	---

（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15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15日 現在				平成30年12月15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	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000	2,385,720,000	-	2,406,900,000	21,180,000
合計	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000	2,385,720,000	-	2,406,900,000	21,180,000

（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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	2,7937円	2,6384円
(1万口当たり純資産額)	(27,937円)	(26,384円)

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,091,585	36,781,192
コール・ローン	99,392,169	130,140,852
親投資信託受益証券	31,815,061,868	32,503,728,721
未収入金	-	50,100,000
流動資産合計	31,915,545,622	32,720,750,765
資産合計	31,915,545,622	32,720,750,765
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,524,952	120,666,880
未払受託者報酬	3,048,135	3,585,754
未払委託者報酬	58,677,590	69,026,539
未払利息	-	309
その他未払費用	763,415	897,977
流動負債合計	95,014,092	194,177,459
負債合計	95,014,092	194,177,459
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,661,230,421	1 28,143,458,955
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,159,301,109	4,383,114,351
（分配準備積立金）	3,133,565,006	2,785,544,280
元本等合計	31,820,531,530	32,526,573,306
純資産合計	31,820,531,530	32,526,573,306
負債純資産合計	31,915,545,622	32,720,750,765

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自	平成30年6月16日 至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		11
有価証券売買等損益		1,372,944,482		2,283,363,147
営業収益合計		1,372,944,482		2,283,363,136
営業費用				
支払利息		14,641		34,583
受託者報酬		2,146,301		3,585,754
委託者報酬		41,317,168		69,026,539
その他費用		536,493		901,277
営業費用合計		44,014,603		73,548,153
営業利益又は営業損失（ ）		1,328,929,879		2,356,911,289
経常利益又は経常損失（ ）		1,328,929,879		2,356,911,289
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,328,929,879		2,356,911,289
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（ ）		48,953,105		31,550,692
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,786,148,437		6,159,301,109
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,005,963,215		1,310,336,085
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,005,963,215		1,310,336,085
剰余金減少額又は欠損金増加額		241,819,710		761,162,246
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		241,819,710		761,162,246
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,830,268,716		4,383,114,351

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	14,953,852,748円	25,661,230,421円
期中追加設定元本額	15,243,885,793円	5,653,858,357円
期中一部解約元本額	4,536,508,120円	3,171,629,823円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	25,661,230,421口	28,143,458,955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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,240円 (12,400円)	1,155円 (11,557円)

（参考）

当ファンドは、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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。

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	170,771,012	174,798,127
金銭信託	6,720,404	37,938,189
コール・ローン	611,913,328	563,825,458
株式	34,565,920,178	35,340,047,323
投資証券	839,789,867	983,589,141
派生商品評価勘定	7,182,208	52,717,058

未収入金		146,133	205,411
未収配当金		65,077,036	56,404,671
差入委託証拠金		340,786,487	403,917,679
流動資産合計		36,608,306,653	37,613,443,057
資産合計		36,608,306,653	37,613,443,057
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		470,094,721	74,922,490
未払解約金		47,051,000	50,470,000
未払利息		-	1,341
その他未払費用		284,825	18,692
流動負債合計		517,430,546	125,412,523
負債合計		517,430,546	125,412,523
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,059,528,948	21,194,289,798
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,031,347,159	16,293,740,736
元本等合計		36,090,876,107	37,488,030,534
純資産合計		36,090,876,107	37,488,030,534
負債純資産合計		36,608,306,653	37,613,443,057

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	12,815,862,979円	19,059,528,948円
期中追加設定元本額	9,283,343,285円	3,118,192,097円
期中一部解約元本額	3,039,677,316円	983,431,247円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	16,801,363,471円	18,376,146,948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（為替ヘッジあり）	1,101,496,652円	1,214,104,082円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	155,311,204円	219,192,830円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	119,630,315円	26,084,521円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	171,395,487円	54,481,926円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	710,331,819円	1,304,279,491円
計	19,059,528,948円	21,194,289,798円
2. 期末日における受益権の総数	19,059,528,948口	21,194,289,798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15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15日 現在				平成30年12月15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	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174	1,261,774,704	-	1,223,178,405	38,596,299
合計	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174	1,261,774,704	-	1,223,178,405	38,596,299

（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15日 現在				平成30年12月15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								
売 建	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687	37,963,378,709	-	37,946,987,842	16,390,867
アメリカ・ドル	23,050,591,704	-	23,440,320,304	389,728,600	25,968,365,280	-	25,991,139,077	22,773,797
イギリス・ ポンド	2,469,653,005	-	2,501,812,782	32,159,777	2,437,580,889	-	2,413,748,051	23,832,838
イスラエル・ シケル	44,994,753	-	44,907,931	86,822	45,490,054	-	44,872,432	617,622
オーストラリ ア・ドル	899,183,431	-	901,270,942	2,087,511	982,542,273	-	964,169,829	18,372,444
カナダ・ドル	1,269,558,170	-	1,272,319,419	2,761,249	1,368,291,162	-	1,358,995,521	9,295,641
シンガポー ル・ドル	193,378,996	-	195,332,320	1,953,324	193,942,476	-	193,825,191	117,285
スイス・フラン	1,053,725,552	-	1,057,009,555	3,284,003	1,220,708,193	-	1,225,699,906	4,991,713
スウェーデ ン・クローナ	378,456,128	-	387,562,624	9,106,496	399,905,471	-	400,280,874	375,403
デンマーク・ クローネ	254,151,958	-	254,941,877	789,919	255,029,648	-	255,561,761	532,113
ニュージー ランド・ドル	33,350,565	-	33,565,970	215,405	33,946,066	-	33,737,654	208,412
ノルウェー・ クローネ	100,547,790	-	102,626,776	2,078,986	113,988,682	-	113,800,448	188,234
ユーロ	4,439,687,813	-	4,458,056,820	18,369,007	4,437,170,707	-	4,444,299,448	7,128,741
香港・ドル	485,773,336	-	493,181,568	7,408,232	506,417,808	-	506,857,650	439,842
合計	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687	37,963,378,709	-	37,946,987,842	16,390,867

(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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.8936円	1.7688円
(1万口当たり純資産額)	(18,936円)	(17,688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) 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16日から平成30年12月15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)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	319,981	2,839,568
コール・ローン	29,135,210	7,375,314
親投資信託受益証券	3,307,217,683	3,574,476,945
未収入金	33,874,800	44,800
流動資産合計	3,370,547,674	3,584,736,627
資産合計	3,370,547,674	3,584,736,627
負債の部		
流動負債		
未払解約金	56,883,038	-
未払受託者報酬	303,548	376,452
未払委託者報酬	5,844,193	7,247,495
未払利息	-	17
その他未払費用	75,927	94,128
流動負債合計	63,106,706	7,718,092
負債合計	63,106,706	7,718,092
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,374,174,372	1 2,679,514,661
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	933,266,596	897,503,874
(分配準備積立金)	323,805,814	284,569,785
元本等合計	3,307,440,968	3,577,018,535
純資産合計	3,307,440,968	3,577,018,535
負債純資産合計	3,370,547,674	3,584,736,627

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		214,308,937		148,050,638
営業収益合計		214,308,937		148,050,637
営業費用				
支払利息		934		2,974
受託者報酬		215,945		376,452
委託者報酬		4,157,877		7,247,495
その他費用		53,903		94,395
営業費用合計		4,428,659		7,721,316
営業利益又は営業損失()		209,880,278		155,771,953
経常利益又は経常損失()		209,880,278		155,771,953
中間純利益又は中間純損失()		209,880,278		155,771,953
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		25,048,709		3,666,727
期首剰余金又は期首欠損金()		313,857,571		933,266,596
剰余金増加額又は欠損金減少額		152,093,862		250,033,270
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		152,093,862		250,033,270
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,187,752		126,357,312
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,187,752		126,357,312
中間剰余金又は中間欠損金()		586,595,250		897,503,874

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,405,993,525円	2,374,174,372円
期中追加設定元本額	1,380,206,909円	625,606,516円
期中一部解約元本額	412,026,062円	320,266,227円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,374,174,372口	2,679,514,661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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3931円 (13,931円)	1,3350円 (13,350円)

(参考)

当ファンドは、「外国株式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。

「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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	541,972,936	291,773,327
金銭信託	1,966,937	9,416,207
コール・ローン	179,095,653	139,940,708
株式	99,506,241,962	100,597,874,075
投資証券	2,485,300,663	2,834,843,991
派生商品評価勘定	2,128,170	270,005

未収入金		434,216	633,373
未収配当金		190,403,446	163,552,394
差入委託証拠金		796,508,844	798,460,798
流動資産合計		103,704,052,827	104,836,764,878
資産合計		103,704,052,827	104,836,764,878
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	24,597,985
未払金		39,376,579	-
未払解約金		96,396,300	17,632,900
未払利息		-	332
その他未払費用		4,294	8,134
流動負債合計		135,777,173	42,239,351
負債合計		135,777,173	42,239,351
純資産の部			
元本等			
元本	1	41,775,947,138	44,014,897,664
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		61,792,328,516	60,779,627,863
元本等合計		103,568,275,654	104,794,525,527
純資産合計		103,568,275,654	104,794,525,527
負債純資産合計		103,704,052,827	104,836,764,878

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	39,756,964,781円	41,775,947,138円
期中追加設定元本額	6,670,399,883円	3,592,032,350円
期中一部解約元本額	4,651,417,526円	1,353,081,824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VA	516,700,593円	499,251,344円
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)	229,429,617円	195,204,265円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	27,312,346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)	734,645,896円	622,892,598円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	- 円	833,591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)	548,554,400円	552,770,509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)	1,334,039,645円	1,501,313,346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 エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	488,855,095円	532,946,423円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,010,873円	5,541,034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)	534,842,007円	736,559,301円
i F r e e 8資産バランス	401,816,816円	564,901,355円
i F r e e 年金バランス	- 円	8,528,196円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	25,684,078,835円	27,653,273,681円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	542,582,707円	568,497,197円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	767,007,247円	839,903,581円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	622,100,357円	677,512,758円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,470,100,006円	1,489,659,533円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	4,277,573円	4,144,265円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,987,127円	13,251,298円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,783,334円	4,210,339円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	- 円	5,627,873円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	76,716円	76,173円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	157,568円	156,042円

ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	668,959円	1,204,032円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	2,223,951円	2,140,945円
ダイワ世界バランスファン ド40VA	323,855,425円	238,397,161円
ダイワ世界バランスファン ド60VA	378,861,282円	348,671,890円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,419,943,699円	3,140,769,877円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	169,136,819円	153,782,925円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	591,527,140円	635,636,644円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	62,177,536円	88,961,091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)	463,548円	453,661円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,735,785,564円	2,740,169,728円
ダイワライフスタイル25	19,963,541円	19,458,131円
ダイワライフスタイル50	70,913,871円	70,150,526円
ダイワライフスタイル75	59,441,318円	58,696,443円
計	41,775,947,138円	44,014,897,664円
2. 期末日における受益権の総数	41,775,947,138口	44,014,897,664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15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15日 現在				平成30年12月15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	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110	1,512,170,401	-	1,487,748,511	24,421,890
合計	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110	1,512,170,401	-	1,487,748,511	24,421,890

(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。

- 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。
- 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。
- 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15日 現在				平成30年12月15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	-	99,459,000	1,215,060	271,802,090	-	271,896,000	93,910

アメリカ・ドル	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060	271,802,090	-	271,896,000	93,910
合計	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060	271,802,090	-	271,896,000	93,910

(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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	2.4791円	2.3809円
(1万口当たり純資産額)	(24,791円)	(23,809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)】

(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16日から平成30年12月15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)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	184,814	2,486,234
コール・ローン	16,827,857	19,723,659
親投資信託受益証券	1,684,443,508	1,651,825,390
未収入金	-	6,200,000
流動資産合計	1,701,456,179	1,680,235,283
資産合計	1,701,456,179	1,680,235,283
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	10,204,124
未払受託者報酬	164,853	184,382
未払委託者報酬	3,256,712	3,642,365
未払利息	-	46
その他未払費用	41,359	46,260
流動負債合計	3,462,924	14,077,177
負債合計	3,462,924	14,077,177
純資産の部		
元本等		
元本	1,232,384,733	1,254,042,042
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	465,608,522	412,116,064
(分配準備積立金)	163,184,866	143,220,881
元本等合計	1,697,993,255	1,666,158,106
純資産合計	1,697,993,255	1,666,158,106
負債純資産合計	1,701,456,179	1,680,235,283

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自	平成30年6月16日 至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		113,725,506		56,598,118
営業収益合計		113,725,506		56,598,116
営業費用				
支払利息		2,963		6,686
受託者報酬		113,552		184,382
委託者報酬		2,243,409		3,642,365
その他費用		28,307		47,033
営業費用合計		2,388,231		3,880,466
営業利益又は営業損失()		111,337,275		60,478,582
経常利益又は経常損失()		111,337,275		60,478,582
中間純利益又は中間純損失()		111,337,275		60,478,582
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		7,790,977		1,505,970
期首剰余金又は期首欠損金()		146,644,116		465,608,522
剰余金増加額又は欠損金減少額		92,928,416		69,286,610
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		92,928,416		69,286,610
剰余金減少額又は欠損金増加額		19,323,895		60,794,516
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		19,323,895		60,794,516
中間剰余金又は中間欠損金()		323,794,935		412,116,064

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	679,453,477円	1,232,384,733円
期中追加設定元本額	695,338,362円	182,459,492円
期中一部解約元本額	142,407,106円	160,802,183円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,232,384,733口	1,254,042,042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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3778円 (13,778円)	1,3286円 (13,286円)

(参考)

当ファンドは、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」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。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「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)」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	36,657,626	38,728,838
金銭信託	564,417	1,950,455

コール・ローン	51,391,860	28,987,055
株式	4,534,181,748	5,150,372,334
投資証券	665,088,728	930,949,699
派生商品評価勘定	44,480	198,430
未収入金	356,353	-
未収配当金	20,795,547	2,549,935
差入委託証拠金	28,092,622	25,217,436
流動資産合計	5,337,173,381	6,178,954,182
資産合計	5,337,173,381	6,178,954,182
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	195,903	2,300,603
未払解約金	15,380,000	4,060,000
未払利息	-	68
その他未払費用	530	628
流動負債合計	15,576,433	6,361,299
負債合計	15,576,433	6,361,299
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,410,057,687
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		1,911,539,261
元本等合計		5,321,596,948
純資産合計		5,321,596,948
負債純資産合計		5,337,173,381

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	2,177,846,631円	3,410,057,687円
期中追加設定元本額	1,566,561,474円	744,479,303円
期中一部解約元本額	334,350,418円	143,356,219円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興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	6,993,217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)	207,947,133円	218,179,157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 エマージングプラス(為替ヘッジなし)	189,070,919円	210,211,590円
D-I's 新興国株式インデックス	70,735,373円	86,700,907円
iFree 新興国株式インデックス	1,068,005,927円	1,302,567,800円
iFree 8資産バランス	623,519,746円	880,923,587円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	836,181,573円	889,604,332円

	ダイワ・インデックスセレクト ト 新興国株式	346,791,758円	357,097,395円
	ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	67,805,258円	58,902,786円
計		3,410,057,687円	4,011,180,771円
2.	期末日における受益権の総数	3,410,057,687口	4,011,180,771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15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15日 現在				平成30年12月15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	37,108,790	-	36,912,887	195,903	58,225,125	-	55,924,522	2,300,603
合計	37,108,790	-	36,912,887	195,903	58,225,125	-	55,924,522	2,300,603

（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15日 現在				平成30年12月15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)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	10,945,520	-	10,990,000	44,480	11,148,570	-	11,347,000	198,430
アメリカ・ドル	10,945,520	-	10,990,000	44,480	11,148,570	-	11,347,000	198,430
合計	10,945,520	-	10,990,000	44,480	11,148,570	-	11,347,000	198,430

（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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.5606円	1.5388円
(1万口当たり純資産額)	(15,606円)	(15,388円)

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	820,627	24,135,471
コール・ローン	74,720,632	58,062,017
親投資信託受益証券	25,095,927,810	26,825,607,211
未収入金	62,785,794	10,381,546
流動資産合計	25,234,254,863	26,918,186,245
資産合計	25,234,254,863	26,918,186,245
負債の部		
流動負債		
未払解約金	96,116,755	27,350,110
未払受託者報酬	1,229,049	1,419,925
未払委託者報酬	15,363,693	17,749,695
未払利息	-	138
その他未払費用	615,315	710,769
流動負債合計	113,324,812	47,230,637
負債合計	113,324,812	47,230,637
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 25,335,886,514	¹ 27,119,523,648
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	² 214,956,463	² 248,568,040
(分配準備積立金)	121,793,614	107,325,665
元本等合計	25,120,930,051	26,870,955,608
純資産合計	25,120,930,051	26,870,955,608
負債純資産合計	25,234,254,863	26,918,186,245

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自	平成30年6月16日 至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		22
有価証券売買等損益		45,065,407		11,033,679
営業収益合計		45,065,407		11,033,701
営業費用				
支払利息		11,332		23,053
受託者報酬		893,209		1,419,925
委託者報酬		11,165,721		17,749,695
その他費用		446,535		714,028
営業費用合計		12,516,797		19,906,701
営業利益又は営業損失()		32,548,610		8,873,000
経常利益又は経常損失()		32,548,610		8,873,000
中間純利益又は中間純損失()		32,548,610		8,873,000
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()		337,977		14,229,288
期首剰余金又は期首欠損金()		205,358,462		214,956,463
剰余金増加額又は欠損金減少額		48,616,795		29,702,037
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		48,616,795		29,702,037
剰余金減少額又は欠損金増加額		127,028,597		68,669,902
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		127,028,597		68,669,902
中間剰余金又は中間欠損金()		251,559,631		248,568,040

(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16日 至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	14,453,552,894円	25,335,886,514円
期中追加設定元本額	17,894,969,975円	5,130,878,877円
期中一部解約元本額	7,012,636,355円	3,347,241,743円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	25,335,886,514口	27,119,523,648口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は214,956,463円であり ます。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は248,568,040円であり ます。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

（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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	0.9915円	0.9908円
（1万口当たり純資産額）	(9,915円)	(9,908円)

（参考）

当ファンドは、「日本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。

「日本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15日現在 金額（円）	平成30年12月15日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,590,675	15,015,246
コール・ローン	235,888,930	223,151,865
国債証券	62,694,390,280	67,232,650,650
地方債証券	4,460,002,450	4,315,274,500

特殊債券	3,338,374,600	3,332,825,600
社債券	3,606,957,200	3,314,702,500
未収利息	208,511,175	214,547,744
前払費用	6,324,909	6,353,645
流動資産合計	74,553,040,219	78,654,521,750
資産合計	74,553,040,219	78,654,521,750
負債の部		
流動負債		
未払解約金	71,156,514	55,423,831
未払利息	-	530
その他未払費用	3,891	3,540
流動負債合計	71,160,405	55,427,901
負債合計	71,160,405	55,427,901
純資産の部		
元本等		
元本	1	53,122,088,329
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,359,791,485	22,547,825,451
元本等合計	74,481,879,814	78,599,093,849
純資産合計	74,481,879,814	78,599,093,849
負債純資産合計	74,553,040,219	78,654,521,750

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16日 至 平成30年12月15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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	45,733,895,667円	53,122,088,329円
期中追加設定元本額	14,320,084,238円	8,188,691,308円
期中一部解約元本額	6,931,891,576円	5,259,511,239円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	144,466,105円	129,097,081円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	930,933,526円	789,231,026円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	111,826,913円	104,162,937円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,283,693,789円	1,072,453,859円
D-I's 日本債券インデックス	761,060円	- 円
DCダイワ日本債券インデックス	5,457,745,439円	5,962,279,095円
ダイワ・バランスファンド35VA	13,867,768,482円	12,966,715,352円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,269,479,451円	2,104,684,213円

ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	312,147,523円	293,362,664円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	416,966,702円	404,370,559円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	56,296,878円	62,176,696円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	17,898,814,500円	19,131,084,875円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	199,030,194円	2,714,945,617円
ダイワファンドラップオンラ イン 日本債券インデックス	1,453,404,501円	1,539,098,830円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,305,882,033円	1,248,821,149円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,333,134,398円	6,451,229,488円
ダイワライフスタイル25	451,884,199円	451,425,021円
ダイワライフスタイル50	489,448,250円	489,384,704円
ダイワライフスタイル75	138,404,386円	136,745,232円
計	53,122,088,329円	56,051,268,398円
2. 期末日における受益権の総数	53,122,088,329口	56,051,268,398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15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15日現在	平成30年12月15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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.4021円	1.4023円
(1万口当たり純資産額)	(14,021円)	(14,023円)

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,896,881	73,205,451
コール・ローン	263,769,854	354,938,209
親投資信託受益証券	61,096,056,167	68,023,119,983
未収入金	-	143,225,038
流動資産合計	61,362,722,902	68,594,488,681
資産合計	61,362,722,902	68,594,488,681
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,344,219	372,331,225
未払受託者報酬	5,970,110	7,072,359
未払委託者報酬	107,462,900	127,303,482
未払利息	-	844
その他未払費用	1,061,497	1,078,797
流動負債合計	207,838,726	507,786,707
負債合計	207,838,726	507,786,707
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 64,540,834,408	¹ 71,795,163,289
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	² 3,385,950,232	² 3,708,461,315
(分配準備積立金)	271,363,864	242,778,000
元本等合計	61,154,884,176	68,086,701,974
純資産合計	61,154,884,176	68,086,701,974
負債純資産合計	61,362,722,902	68,594,488,681

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		34
有価証券売買等損益		16,435,116		205,216,504
営業収益合計		16,435,116		205,216,538
営業費用				
支払利息		34,569		80,597
受託者報酬		4,284,047		7,072,359
委託者報酬		77,113,523		127,303,482
その他費用		1,100,714		1,086,761
営業費用合計		82,532,853		135,543,199
営業利益又は営業損失（ ）		66,097,737		69,673,339
経常利益又は経常損失（ ）		66,097,737		69,673,339
中間純利益又は中間純損失（ ）		66,097,737		69,673,339
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		25,944,727		22,582,972
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,007,882,132		3,385,950,232
剰余金増加額又は欠損金減少額		161,990,669		403,929,111
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		161,990,669		403,929,111
剰余金減少額又は欠損金増加額		687,835,302		818,696,505
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		687,835,302		818,696,505
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,573,879,775		3,708,461,315

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	34,752,986,225円	64,540,834,408円
期中追加設定元本額	41,568,085,908円	14,950,157,198円
期中一部解約元本額	11,780,237,725円	7,695,828,317円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	64,540,834,408口	71,795,163,289口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,385,950,232円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,708,461,315円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

(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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9475円 (9,475円)	0.9483円 (9,483円)

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)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。

「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	284,212,058	685,212,913
金銭信託	32,356,713	37,064,442
コール・ローン	2,946,177,671	550,840,098
国債証券	62,822,098,221	80,304,638,411

派生商品評価勘定		28,448,168	80,865,981
未収利息		420,542,318	501,510,002
前払費用		54,845,725	68,507,112
差入委託証拠金		68,896,960	110,968,159
流動資産合計		66,657,577,834	82,339,607,118
資産合計		66,657,577,834	82,339,607,118
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		856,003,067	195,614,723
未払解約金		-	143,346,939
未払利息		-	1,310
その他未払費用		24,246	25,169
流動負債合計		856,027,313	338,988,141
負債合計		856,027,313	338,988,141
純資産の部			
元本等			
元本	1	68,969,365,389	85,684,228,291
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	2	3,167,814,868	3,683,609,314
元本等合計		65,801,550,521	82,000,618,977
純資産合計		65,801,550,521	82,000,618,977
負債純資産合計		66,657,577,834	82,339,607,118

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首 期首元本額	平成29年6月16日 35,493,735,600円	平成30年6月16日 68,969,365,389円

期中追加設定元本額	37,519,095,983円	18,335,875,440円
期中一部解約元本額	4,043,466,194円	1,621,012,538円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	64,035,275,304円	71,086,968,318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(為替ヘッジあり)	3,469,288,196円	3,794,765,833円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	1,464,801,889円	10,802,494,140円
計	68,969,365,389円	85,684,228,291円
2. 期末日における受益権の総数	68,969,365,389口	85,684,228,291口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,167,814,868円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,683,609,314円であります。

(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15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. 債券関連

種 類	平成30年6月15日 現在				平成30年12月15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								
債券先物取引								
買 建	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155	-	-	-	-
合計	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155	-	-	-	-

(注) 1. 時価の算定方法

債券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。

- 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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。
- 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15日 現在				平成30年12月15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								
売 建	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054	80,914,578,948	-	81,029,327,690	114,748,742
アメリカ・ドル	27,240,290,248	-	27,771,494,530	531,204,282	37,213,736,749	-	37,274,567,000	60,830,251
イギリス・ポンド	4,503,775,286	-	4,569,338,340	65,563,054	5,382,798,137	-	5,336,429,510	46,368,627
オーストラリア・ドル	1,364,464,868	-	1,370,891,860	6,426,992	1,748,142,501	-	1,728,296,280	19,846,221

カナダ・ドル	1,414,734,319	-	1,424,666,220	9,931,901	1,692,507,932	-	1,686,538,500	5,969,432
シンガポ ル・ドル	250,268,736	-	253,360,600	3,091,864	314,746,656	-	315,271,600	524,944
スイス・フラン	92,555,627	-	92,865,150	309,523	-	-	-	-
スウェー デン・クロー ナ	250,277,496	-	257,084,960	6,807,464	265,764,360	-	266,889,000	1,124,640
デンマーク ・クローネ	352,938,868	-	355,556,360	2,617,492	480,845,606	-	482,598,480	1,752,874
ノルウェー ・クローネ	190,273,514	-	194,805,100	4,531,586	189,511,318	-	190,483,880	972,562
ポーランド ・ズロチ	407,585,909	-	414,309,400	6,723,491	507,607,381	-	508,800,360	1,192,979
マレーシア ・リンギット	278,648,216	-	283,686,480	5,038,264	275,906,593	-	277,136,720	1,230,127
メキシコ・ペソ	482,197,808	-	471,812,560	10,385,248	555,915,822	-	559,002,400	3,086,578
ユーロ	25,723,592,209	-	25,936,968,900	213,376,691	31,853,405,912	-	31,978,305,680	124,899,768
南アフリカ ・ランド	367,021,642	-	352,255,340	14,766,302	433,689,981	-	425,008,280	8,681,701
合計	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054	80,914,578,948	-	81,029,327,690	114,748,742

(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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	0.9541円	0.9570円

(1万口当たり純資産額)	(9,541円)	(9,570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)】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	145,644	5,574,073
コール・ローン	13,261,330	8,288,224
親投資信託受益証券	2,403,653,220	3,119,635,661
未収入金	-	2,499,030
流動資産合計	2,417,060,194	3,135,996,988
資産合計	2,417,060,194	3,135,996,988
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,919,914	2,728,186
未払受託者報酬	219,671	292,198
未払委託者報酬	3,954,915	5,260,298
未払利息	-	19
その他未払費用	82,394	109,605
流動負債合計	11,176,894	8,390,306
負債合計	11,176,894	8,390,306
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,246,613,872	1 2,856,939,911
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	159,269,428	270,666,771
(分配準備積立金)	9,444,467	8,536,108
元本等合計	2,405,883,300	3,127,606,682
純資産合計	2,405,883,300	3,127,606,682
負債純資産合計	2,417,060,194	3,135,996,988

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		80,463,752		68,101,138
営業収益合計		80,463,752		68,101,139
営業費用				
支払利息		1,239		2,987
受託者報酬		167,816		292,198
委託者報酬		3,021,631		5,260,298
その他費用		62,857		109,944
営業費用合計		3,253,543		5,665,427
営業利益		77,210,209		62,435,712
経常利益		77,210,209		62,435,712
中間純利益		77,210,209		62,435,712
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		19,231,707		3,247,863
期首剰余金又は期首欠損金()		82,225,804		159,269,428
剰余金増加額又は欠損金減少額		48,776,102		70,368,626
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		48,776,102		70,368,626
剰余金減少額又は欠損金増加額		29,207,386		18,159,132
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		29,207,386		18,159,132
中間剰余金又は中間欠損金()		159,773,022		270,666,771

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,322,658,686円	2,246,613,872円
期中追加設定元本額	1,454,615,593円	862,116,378円
期中一部解約元本額	530,660,407円	251,790,339円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,246,613,872口	2,856,939,911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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0709円 (10,709円)	1.0947円 (10,947円)

（参考）

当ファンドは、「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。

「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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	450,277,438	132,271,165
金銭信託	6,740,515	48,689,040
コール・ローン	613,744,470	723,601,226
国債証券	161,781,211,688	168,490,477,543
派生商品評価勘定	6,412,552	1,056,611
未収入金	2,107,837	27,151

未収利息	1,200,038,774	1,222,991,718
前払費用	33,324,989	36,943,718
流動資産合計	164,093,858,263	170,656,058,172
資産合計	164,093,858,263	170,656,058,172
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,138,003	861,868
未払金	-	65,165
未払解約金	94,056,724	64,209,163
未払利息	-	1,721
その他未払費用	13,859	14,173
流動負債合計	95,208,586	65,152,090
負債合計	95,208,586	65,152,090
純資産の部		
元本等		
元本	1	60,439,178,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	103,559,471,658	109,225,381,782
元本等合計	163,998,649,677	170,590,906,082
純資産合計	163,998,649,677	170,590,906,082
負債純資産合計	164,093,858,263	170,656,058,172

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	59,482,440,391円	60,439,178,019円
期中追加設定元本額	6,470,833,619円	2,943,531,074円
期中一部解約元本額	5,514,095,991円	2,017,184,793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	854,523,679円	693,772,401円
V A		
ダイワ国内重視バランスファ	29,450,309円	26,063,629円
ンド30 V A(一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	206,824,310円	171,491,829円
ンド50 V A(一般投資家私		
募)		
ダイワ国際分散バランスファ	57,761,758円	52,710,212円
ンド30 V A(一般投資家私		
募)		

ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	662,292,154円	544,620,207円
外国債券インデックスファンド(FOFs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)	353,339,336円	358,084,269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)	885,845,515円	1,122,292,212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 エマージングプラス(為替ヘッジなし)	641,273,428円	708,364,374円
D-I's 外国債券インデックス	935,352円	731,384円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	27,099円	27,109円
iFree 外国債券インデックス	435,441,531円	503,896,211円
iFree 8資産バランス	363,248,667円	490,082,407円
iFree 年金バランス	- 円	4,373,827円
DCダイワ外国債券インデックス	41,138,711,641円	42,399,285,831円
ダイワ・ライフ・バランス30	718,124,357円	739,788,743円
ダイワ・ライフ・バランス50	345,053,257円	368,136,096円
ダイワ・ライフ・バランス70	224,187,800円	237,768,692円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	301,508,138円	329,356,769円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	246,918,816円	263,642,484円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	78,267,023円	82,547,093円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	11,123,826円	10,485,123円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	18,255,807円	18,657,551円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,700,379円	1,851,074円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	- 円	1,317,696円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	337,001,995円	246,851,720円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	168,856,742円	154,707,266円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,143,693,045円	5,646,857,484円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	83,827,530円	17,076,090円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	27,516,152円	8,295,099円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	349,404,648円	325,032,492円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	139,464,733円	142,879,498円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	26,817,344円	28,398,699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)	369,220円	27,703,290円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,470,401,280円	5,521,509,789円
ダイワライフスタイル25	35,960,613円	35,190,841円
ダイワライフスタイル50	63,227,770円	62,125,559円
ダイワライフスタイル75	17,822,765円	17,346,212円
計	60,439,178,019円	61,365,524,300円
2. 期末日における受益権の総数	60,439,178,019口	61,365,524,300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15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15日 現在				平成30年12月15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	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549	770,755,037	-	770,949,780	194,743
アメリカ・ドル	267,833,163	-	272,345,920	4,512,757	219,903,049	-	220,540,180	637,131
イギリス・ポンド	-	-	-	-	42,976,998	-	42,598,710	378,288
オーストラリア・ドル	16,985,074	-	17,065,080	80,006	14,552,556	-	14,386,240	166,316
カナダ・ドル	10,541,009	-	10,615,500	74,491	48,774,121	-	48,993,070	218,949
シンガポール・ドル	-	-	-	-	12,623,052	-	12,645,450	22,398
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	28,784,040	-	28,753,270	30,770
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	7,193,659	-	7,229,040	35,381
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	10,785,429	-	10,748,460	36,969
メキシコ・ペソ	15,871,398	-	15,544,320	327,078	-	-	-	-
ユーロ	254,923,461	-	256,439,500	1,516,039	385,162,133	-	385,055,360	106,773
南アフリカ・ランド	20,123,006	-	19,541,340	581,666	-	-	-	-

合計	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549	770,755,037	-	770,949,780	194,743

(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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	2.7134円	2.7799円
(1万口当たり純資産額)	(27,134円)	(27,799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)】

(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16日から平成30年12月15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)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	61,159	1,039,080
コール・ローン	5,568,760	3,562,496
親投資信託受益証券	1,194,460,520	1,244,744,581
未収入金	7,881,767	2,069,021
流動資産合計	1,207,972,206	1,251,415,178
資産合計	1,207,972,206	1,251,415,178
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,076,705	2,059,443
未払受託者報酬	118,829	132,875
未払委託者報酬	2,199,274	2,459,160
未払利息	-	8
その他未払費用	44,533	49,790
流動負債合計	12,439,341	4,701,276
負債合計	12,439,341	4,701,276
純資産の部		
元本等		
元本	1,112,542,866	1,137,665,911
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	82,989,999	109,047,991
(分配準備積立金)	13,310,528	11,663,931
元本等合計	1,195,532,865	1,246,713,902
純資産合計	1,195,532,865	1,246,713,902
負債純資産合計	1,207,972,206	1,251,415,178

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		34,355,897		26,947,763
その他収益		-		9,051
営業収益合計		34,355,897		26,956,814
営業費用				
支払利息		438		1,124
受託者報酬		83,788		132,875
委託者報酬		1,551,003		2,459,160
その他費用		31,342		49,892
営業費用合計		1,666,571		2,643,051
営業利益		32,689,326		24,313,763
経常利益		32,689,326		24,313,763
中間純利益		32,689,326		24,313,763
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		2,987,058		1,487,836
期首剰余金又は期首欠損金()		41,637,159		82,989,999
剰余金増加額又は欠損金減少額		34,434,623		14,459,177
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		34,434,623		14,459,177
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,313,884		11,227,112
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,313,884		11,227,112
中間剰余金又は中間欠損金()		99,460,166		109,047,991

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	557,544,250円	1,112,542,866円
期中追加設定元本額	683,181,594円	174,385,375円
期中一部解約元本額	128,182,978円	149,262,330円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,112,542,866口	1,137,665,911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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0746円 (10,746円)	1.0959円 (10,959円)

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券及び「ダイワ新興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。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「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)」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	62,827,549	124,503,556
金銭信託	1,022,784	3,251,194

コール・ローン	93,127,644	48,318,227
国債証券	8,713,400,729	10,426,079,335
派生商品評価勘定	190,647	187,953
未収入金	13,072	25,808
未収利息	147,130,183	166,428,912
前払費用	30,176,649	17,475,736
流動資産合計	9,047,889,257	10,786,270,721
資産合計	9,047,889,257	10,786,270,721
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	830,455	588,355
未払金	-	340,567
未払解約金	17,515,053	149,458
未払利息	-	114
その他未払費用	1,837	1,970
流動負債合計	18,347,345	1,080,464
負債合計	18,347,345	1,080,464
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,882,755,540
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		2,146,786,372
元本等合計		9,029,541,912
純資産合計		9,029,541,912
負債純資産合計		9,047,889,257

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	3,958,047,683円	6,882,755,540円
期中追加設定元本額	3,396,346,573円	1,402,184,094円
期中一部解約元本額	471,638,716円	152,081,013円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投 資家専用)	- 円	1,275,649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)	179,670,376円	188,081,861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)	326,925,628円	371,353,931円
D-I's 新興国債券イン デックス	45,764,193円	50,887,771円
iFree 新興国債券イン デックス	1,340,012,391円	1,743,838,864円
iFree 8資産バランス	739,451,734円	1,021,199,278円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	4,039,037,258円	4,539,292,937円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	183,461,837円	186,329,258円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	28,432,123円	30,599,072円
計	6,882,755,540円	8,132,858,621円
2. 期末日における受益権の総数	6,882,755,540口	8,132,858,621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15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15日 現在				平成30年12月15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	85,362,698	-	84,722,890	639,808	76,521,091	-	76,120,689	400,402
チェコ・コルナ	29,407,028	-	29,571,500	164,472	4,957,840	-	4,995,000	37,160
トルコ・リラ	25,357,561	-	24,791,900	565,661	18,400,490	-	18,038,780	361,710
ハンガリー・ フォリント	15,689,071	-	15,562,800	126,271	6,134,543	-	6,125,109	9,434
ポーランド・ ズロチ	2,685,078	-	2,682,900	2,178	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	6,969,010	-	6,864,000	105,010	35,998,768	-	35,889,800	108,968
ルーマニア・ レイ	3,207,100	-	3,202,290	4,810	11,029,450	-	11,072,000	42,550
南アフリカ・ ランド	2,047,850	-	2,047,500	350	-	-	-	-
合計	85,362,698	-	84,722,890	639,808	76,521,091	-	76,120,689	400,402

（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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.3119円	1.3261円
(1万口当たり純資産額)	(13,119円)	(13,261円)

【ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	392,419	10,196,180
コール・ローン	35,730,950	11,692,991
親投資信託受益証券	2,350,731,287	2,693,181,626
未収入金	16,850,000	1,890,000
流動資産合計	2,403,704,656	2,716,960,797
資産合計	2,403,704,656	2,716,960,797
負債の部		
流動負債		
未払解約金	44,666,343	4,917,315
未払受託者報酬	232,555	271,224
未払委託者報酬	3,372,589	3,933,501
未払利息	-	27
その他未払費用	58,200	67,871
流動負債合計	48,329,687	9,189,938
負債合計	48,329,687	9,189,938
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,297,924,064	1 2,489,063,313
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	57,450,905	218,707,546
(分配準備積立金)	99,070,831	88,149,877
元本等合計	2,355,374,969	2,707,770,859
純資産合計	2,355,374,969	2,707,770,859
負債純資産合計	2,403,704,656	2,716,960,797

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		3
有価証券売買等損益	15,222,087		156,969,339	
その他収益	268		-	
営業収益合計	15,221,819		156,969,342	
営業費用				
支払利息	1,551		4,112	
受託者報酬	159,461		271,224	
委託者報酬	2,313,047		3,933,501	
その他費用	39,786		68,344	
営業費用合計	2,513,845		4,277,181	
営業利益又は営業損失()	17,735,664		152,692,161	
経常利益又は経常損失()	17,735,664		152,692,161	
中間純利益又は中間純損失()	17,735,664		152,692,161	
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()	3,429,811		7,156,839	
期首剰余金又は期首欠損金()	11,573,487		57,450,905	
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,056,439		23,119,125	
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,056,439		-	
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		23,119,125	
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,730,544		7,397,806	
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		7,397,806	
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,730,544		-	
中間剰余金又は中間欠損金()	61,553,445		218,707,546	

(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16日	至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,235,784,993円	2,297,924,064円
期中追加設定元本額	1,366,263,589円	469,188,299円
期中一部解約元本額	304,124,518円	278,049,050円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,297,924,064口	2,489,063,313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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0250円 (10,250円)	1.0879円 (10,879円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ」-REIT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。

「ダイワ」-REIT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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	38,099,261	138,250,747
コール・ローン	3,469,054,314	2,054,639,208
投資証券 2	209,017,190,580	220,170,218,860
派生商品評価勘定	18,885,600	35,805,600
未収入金	1,060,294,414	-
未収配当金	1,315,936,685	1,407,067,229

流動資産合計		214,919,460,854	223,805,981,644
資産合計		214,919,460,854	223,805,981,644
負債の部			
流動負債			
前受金		16,380,000	9,900,000
未払解約金		2,702,297,400	84,725,000
未払利息		-	4,887
その他未払費用		36,292	32,208
流動負債合計		2,718,713,692	94,662,095
負債合計		2,718,713,692	94,662,095
純資産の部			
元本等			
元本	1	84,131,299,324	83,413,773,668
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		128,069,447,838	140,297,545,881
元本等合計		212,200,747,162	223,711,319,549
純資産合計		212,200,747,162	223,711,319,549
負債純資産合計		214,919,460,854	223,805,981,644

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	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。
	受取配当金 原則として、投資証券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15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	110,682,384,557円	84,131,299,324円
期中追加設定元本額	4,835,703,556円	5,142,687,520円
期中一部解約元本額	31,386,788,789円	5,860,213,176円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	8,634,387,920円	7,464,522,303円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	68,030,957,225円	67,861,883,601円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	427,102,393円	373,858,909円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	29,232円	28,858円
iFree J-REITイ ンデックス	123,106,225円	126,508,455円
iFree 8資産バランス	390,865,743円	505,556,894円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,554,437,382円	3,884,999,157円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,995,920円	2,733,692円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,407,352円	5,348,275円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,334,004円	1,385,927円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	54,950,461円	47,203,613円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	931,979,260円	1,004,206,580円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	127,599,903円	389,128,464円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	351,216,953円	383,473,404円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,494,929,351円	1,362,935,536円
計		84,131,299,324円	83,413,773,668円
2.	期末日における受益権の総数	84,131,299,324口	83,413,773,668口
3.	2 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。 投資証券 371,400,000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。 投資証券 419,400,000円

(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15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

不動産投信関連

種 類	平成30年6月15日 現在				平成30年12月15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								

不動産投信 指数先物取引								
買建	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000	3,189,600,000	-	3,225,600,000	36,000,000
合計	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000	3,189,600,000	-	3,225,600,000	36,000,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	2.5223円	2.6819円
(1万口当たり純資産額)	(25,223円)	(26,819円)

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	255,328	12,380,487
コール・ローン	23,248,416	27,618,398
親投資信託受益証券	8,805,742,899	9,727,111,577
派生商品評価勘定	330,380	19,433,435
未収入金	-	13,062,385
流動資産合計	8,829,577,023	9,799,606,282
資産合計		
	8,829,577,023	9,799,606,282
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	119,702,888	7,505,868
未払金	9,566	145,630
未払解約金	4,682,249	21,108,739
未払受託者報酬	837,713	1,008,676
未払委託者報酬	15,708,135	18,913,342
未払利息	-	65
その他未払費用	209,790	252,474
流動負債合計	141,150,341	48,934,794
負債合計		
	141,150,341	48,934,794
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,936,929,166	1 9,945,929,642
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 248,502,484	2 195,258,154
(分配準備積立金)	192,092,032	172,878,423
元本等合計	8,688,426,682	9,750,671,488
純資産合計		
	8,688,426,682	9,750,671,488
負債純資産合計		
	8,829,577,023	9,799,606,282

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益	329,073,321		374,748,678	
為替差損益	224,375,245		289,913,154	
営業収益合計	104,698,076		84,835,525	
営業費用				
支払利息	4,849		8,271	
受託者報酬	658,852		1,008,676	
委託者報酬	12,354,419		18,913,342	
その他費用	175,437		264,158	
営業費用合計	13,193,557		20,194,447	
営業利益	91,504,519		64,641,078	
経常利益	91,504,519		64,641,078	
中間純利益	91,504,519		64,641,078	
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()	2,320,667		12,295,296	
期首剰余金又は期首欠損金()	83,499,628		248,502,484	
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,536,898		25,697,262	
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,536,898		25,697,262	
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,798,713		24,798,714	
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,798,713		24,798,714	
中間剰余金又は中間欠損金()	37,936,257		195,258,154	

(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16日 至 平成30年12月15日	
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。	
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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	5,369,088,014円	8,936,929,166円
期中追加設定元本額	4,660,565,456円	1,993,634,373円
期中一部解約元本額	1,092,724,304円	984,633,897円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	8,936,929,166口	9,945,929,642口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は248,502,484円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は195,258,154円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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)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	前計算期間末 平成30年6月15日 現在				当中間計算期間末 平成30年12月15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								
売 建	8,592,500,919	-	8,711,873,427	119,372,508	9,765,892,611	-	9,753,965,044	11,927,567
アメリカ・ドル	6,084,377,844	-	6,187,252,167	102,874,323	7,137,103,093	-	7,143,365,002	6,261,909
イギリス・ポンド	502,220,533	-	508,612,557	6,392,024	497,375,932	-	492,512,963	4,862,969
イスラエル・シケル	5,392,636	-	5,381,238	11,398	5,744,387	-	5,663,306	81,081

オーストラリア・ドル	699,255,108	-	700,814,640	1,559,532	686,415,675	-	673,609,069	12,806,606
カナダ・ドル	156,231,633	-	156,539,714	308,081	178,666,302	-	177,445,567	1,220,735
シンガポール・ドル	287,809,650	-	290,620,656	2,811,006	325,551,172	-	325,355,625	195,547
ニュージーランド・ドル	38,668,464	-	38,940,209	271,745	43,641,410	-	43,375,876	265,534
ユーロ	631,581,728	-	634,051,460	2,469,732	671,346,301	-	672,414,536	1,068,235
香港・ドル	186,963,323	-	189,660,786	2,697,463	220,048,339	-	220,223,100	174,761
合計	8,592,500,919	-	8,711,873,427	119,372,508	9,765,892,611	-	9,753,965,044	11,927,567

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 中間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。

中間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、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

中間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ない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 中間計算期間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。
- ・ 中間計算期間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) 中間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、中間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。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	0.9722円	0.9804円
(1万口当たり純資産額)	(9,722円)	(9,804円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・グローバルREIT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。

「ダイワ・グローバルREIT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15日現在	平成30年12月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	49,907,321	70,320,668
金銭信託	1,711,640	5,320,874
コール・ローン	155,850,086	79,077,154
投資信託受益証券	137,679,722	176,965,753
投資証券	16,471,872,345	19,304,617,844
派生商品評価勘定	828,281	867,669
未収入金	197,007	8,109
未収配当金	32,903,547	29,944,032
差入委託証拠金	37,424,658	31,764,992
流動資産合計	16,888,374,607	19,698,887,095
資産合計	16,888,374,607	19,698,887,095
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	702,774	2,879,084
未払金	28,930,016	18,152,606
未払株式払込金	-	1,139,319
未払解約金	20,267,000	17,398,000
未払利息	-	188
その他未払費用	2,034	1,954
流動負債合計	49,901,824	39,571,151
負債合計	49,901,824	39,571,151
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,648,262,213	8,574,137,510

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,190,210,570	11,085,178,434
元本等合計	16,838,472,783	19,659,315,944
純資産合計	16,838,472,783	19,659,315,944
負債純資産合計	16,888,374,607	19,698,887,095

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16日 至 平成30年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)出資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、出資証券、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首	平成29年6月16日	平成30年6月16日
期首元本額	4,755,388,415円	7,648,262,213円
期中追加設定元本額	3,327,846,253円	1,418,485,020円
期中一部解約元本額	434,972,455円	492,609,723円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	3,999,701,535円	4,242,274,664円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	540,038,266円	603,241,599円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	323,038,547円	333,145,160円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	227,561,132円	244,050,197円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,222,466円	1,218,954円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	35,023円	33,252円
iFree 外国REITイ ンデックス	70,112,709円	76,225,105円
iFree 8資産バランス	453,719,542円	588,044,396円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	1,576,902,629円	1,739,895,088円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,424,485円	3,180,473円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,256,261円	6,164,552円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,336,304円	1,416,414円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	284,483,123円	260,044,351円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	25,922,759円	26,748,464円

	ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	129,954,928円	227,933,210円
	ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,552,504円	220,521,631円
計		7,648,262,213円	8,574,137,510円
2.	期末日における受益権の総数	7,648,262,213口	8,574,137,510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15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. 不動産投信関連

種 類	平成30年6月15日 現在				平成30年12月15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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	164,465,621	-	164,086,117	379,504	131,717,443	-	129,564,327	2,153,116

合計	164,465,621	-	164,086,117	379,504	131,717,443	-	129,564,327	2,153,116

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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15日 現在				平成30年12月15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	108,411,289	-	108,916,300	505,011	36,111,099	-	36,252,800	141,701
アメリカ・ドル	82,330,999	-	82,893,700	562,701	36,111,099	-	36,252,800	141,701
シンガポール・ドル	10,666,392	-	10,674,600	8,208	-	-	-	-
ユーロ	15,413,898	-	15,348,000	65,898	-	-	-	-
合計	108,411,289	-	108,916,300	505,011	36,111,099	-	36,252,800	141,701

(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15日現在	平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額	2,2016円	2,2929円
(1万口当たり純資産額)	(22,016円)	(22,929円)

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

(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16日から平成30年12月15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。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 平成30年6月15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	101,438	1,890,684
コール・ローン	9,236,199	2,852,483
親投資信託受益証券	1,188,948,246	1,383,172,662
未収入金	6,340,000	3,034,000
流動資産合計	1,204,625,883	1,390,949,829
資産合計	1,204,625,883	1,390,949,829
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,274,604	3,118,769
未払受託者報酬	111,131	140,410
未払委託者報酬	2,084,515	2,633,310
未払利息	-	6
その他未払費用	27,742	35,052
流動負債合計	15,497,992	5,927,547
負債合計	15,497,992	5,927,547
純資産の部		
元本等		
元本	1,094,522,792	1,226,538,487
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	94,605,099	158,483,795
(分配準備積立金)	34,010,134	30,411,375
元本等合計	1,189,127,891	1,385,022,282
純資産合計	1,189,127,891	1,385,022,282
負債純資産合計	1,204,625,883	1,390,949,829

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 平成29年6月16日	至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日	至 平成30年12月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		40,174,686		50,761,416
営業収益合計		40,174,686		50,761,416
営業費用				
支払利息		393		1,131
受託者報酬		81,517		140,410
委託者報酬		1,529,091		2,633,310
その他費用		20,308		35,134
営業費用合計		1,631,309		2,809,985
営業利益		38,543,377		47,951,431
経常利益		38,543,377		47,951,431
中間純利益		38,543,377		47,951,431
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		1,465,521		4,004,301
期首剰余金又は期首欠損金()		41,449,491		94,605,099
剰余金増加額又は欠損金減少額		28,945,129		31,567,383
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		28,945,129		31,567,383
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,237,074		11,635,817
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,237,074		11,635,817
中間剰余金又は中間欠損金()		103,235,402		158,483,795

(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16日 至 平成30年12月15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	当中間計算期間末
	平成30年6月15日現在	平成30年12月15日現在
1. 1 期首元本額	568,394,416円	1,094,522,792円
期中追加設定元本額	637,956,340円	261,478,107円
期中一部解約元本額	111,827,964円	129,462,412円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,094,522,792口	1,226,538,487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 平成29年6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成30年6月16日 至 平成30年12月15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15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15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15日現在	当中間計算期間末 平成30年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0864円 (10,864円)	1.1292円 (11,292円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・グローバルREIT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。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」に記載のとおりであります。

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

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	2
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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
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)

	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	当事業年度
	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（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	当事業年度
	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（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	当事業年度
	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（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的主要原因別内訳

（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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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 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）の平成30年6月16日から平成30年12月15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）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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）の平成30年6月16日から平成30年12月15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）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ J - R E I T インデックスの平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップTOPIXインデックスの平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップTOPIXインデックスの平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 日経225インデックスの平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの平成30年12月15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16日から平成30年12月15日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年1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 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ファンドラップ 日本債券インデックスの平成30年6月16日から平成30年12月15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、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの平成30年12月15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16日から平成30年12月15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。