

【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29日提出
【計算期間】	第6計算期間中 （自 平成30年7月6日 至 平成31年1月5日）
【ファンド名】	ダイワＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド （為替ヘッジあり／年1回決算型）
【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】

(1) 【投資状況】（2019年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	102,141,668	98.86
内 ケイマン諸島	102,141,668	98.86
親投資信託受益証券	9,977	0.01
内 日本	9,977	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,165,813	1.13
純資産総額	103,317,458	100.00

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

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

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2014年7月7日)	82,869,854	82,869,854	1.0110	1.0110
第2計算期間末 (2015年7月6日)	112,293,080	112,293,080	0.9855	0.9855
第3計算期間末 (2016年7月5日)	118,177,690	118,177,690	0.9430	0.9430
第4計算期間末 (2017年7月5日)	130,746,909	130,746,909	0.9705	0.9705
2018年1月末日	124,857,330	-	0.9635	-
2月末日	123,436,770	-	0.9559	-
3月末日	123,835,293	-	0.9510	-
4月末日	120,144,640	-	0.9520	-
5月末日	119,269,051	-	0.9495	-
6月末日	117,523,641	-	0.9438	-
第5計算期間末 (2018年7月5日)	117,480,060	117,480,060	0.9424	0.9424
7月末日	117,659,769	-	0.9453	-
8月末日	117,925,526	-	0.9453	-
9月末日	116,422,954	-	0.9444	-
10月末日	113,085,286	-	0.9327	-

11月末日	109,689,616	-	0.9251	-
12月末日	100,930,349	-	0.9038	-
2019年1月末日	103,317,458	-	0.9220	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2018年7月6日～ 2019年1月5日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	2.5
第3計算期間	4.3
第4計算期間	2.9
第5計算期間	2.9
2018年7月6日～ 2019年1月5日	3.9

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

(1) 投資状況（2019年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	46,733,850,758	100.00
純資産総額	46,733,850,758	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

●ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)

2019年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,220円
純資産総額	1.0億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.0%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	-2.5%
1年間	-4.3%
3年間	2.5%
5年間	-8.0%
設定来	-7.8%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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 14年7月	第2期 15年7月	第3期 16年7月	第4期 17年7月	第5期 18年7月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

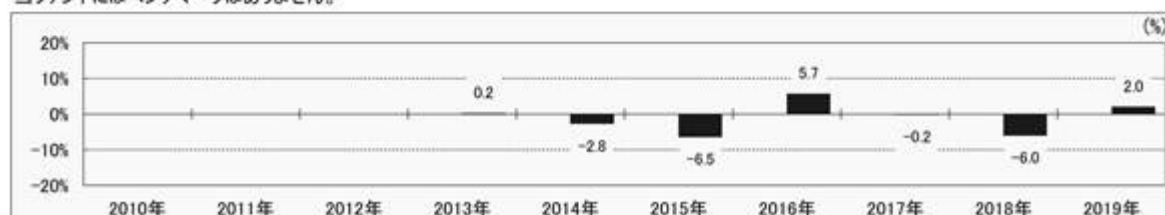
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
プリンシパル・グローバル・インベスターズ・エルエルシー	US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円ヘッジ/NIクラス)	98.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.0%
合計		98.9%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2013年は設定日(11月27日)から年末、2019年は1月31日までの騰落率を表しています。

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

2 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	82,835,354	1,863,180
第2計算期間	50,030,711	18,058,189
第3計算期間	24,785,902	13,407,243
第4計算期間	30,702,129	21,300,646
第5計算期間	14,509,412	24,570,983
2018年7月6日～ 2019年1月5日	5,479,968	18,334,010

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

3 【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成30年7月6日から平成31年1月5日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 平成30年7月5日現在	当中間計算期間末 平成31年1月5日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,334,828	1,700,190
投資信託受益証券	115,847,330	100,237,410
親投資信託受益証券	9,982	9,977
流動資産合計	118,192,140	101,947,577
資産合計	118,192,140	101,947,577
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	19,607	18,493
未払委託者報酬	687,516	649,401
その他未払費用	4,957	4,683
流動負債合計	712,080	672,577
負債合計	712,080	672,577
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 124,663,267	¹ 111,809,225
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	² 7,183,207	² 10,534,225
（分配準備積立金）	190,513	163,348
元本等合計	117,480,060	101,275,000
純資産合計	117,480,060	101,275,000
負債純資産合計	118,192,140	101,947,577

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成29年7月6日 至 平成30年1月5日	当中間計算期間 自 平成30年7月6日 至 平成31年1月5日
営業収益		
有価証券売買等損益	90,028	3,609,925
営業収益合計	90,028	3,609,925
営業費用		
支払利息	454	313
受託者報酬	20,861	18,493
委託者報酬	731,241	649,401
その他費用	5,156	4,896
営業費用合計	757,712	673,103
営業損失（ ）	667,684	4,283,028
経常損失（ ）	667,684	4,283,028
中間純損失（ ）	667,684	4,283,028
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	19,226	218,705
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,977,929	7,183,207
剰余金増加額又は欠損金減少額	357,605	1,056,513
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	357,605	1,056,513
剰余金減少額又は欠損金増加額	275,323	343,208
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	275,323	343,208
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,544,105	10,534,225

(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7月6日 至 平成31年1月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 平成30年7月5日現在	当中間計算期間末 平成31年1月5日現在
1. 1 期首元本額	134,724,838円	124,663,267円
期中追加設定元本額	14,509,412円	5,479,968円
期中一部解約元本額	24,570,983円	18,334,010円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	124,663,267口	111,809,225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7,183,207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10,534,225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 自 平成29年7月6日 至 平成30年1月5日	当中間計算期間 自 平成30年7月6日 至 平成31年1月5日
	該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成31年1月5日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 平成30年7月5日現在	当中間計算期間末 平成31年1月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成30年7月5日現在	当中間計算期間末 平成31年1月5日現在
1口当たり純資産額	0.9424円	0.9058円
（1万口当たり純資産額）	(9,424円)	(9,058円)

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワノプリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」の受益証券（円建）を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・プレミアム・トラスト - ダイワノプリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」の状況

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

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（米ドル建て）

貸借対照表
2018年6月29日

資産	
投資資産の評価額（簿価 \$7,341,350）	\$ 7,269,220
現金	183
外国為替先渡契約による評価益	49
未収：	
売却済みの投資資産	195
利息	76,438
資産合計	7,346,085
負債	
外国為替先渡契約による評価損	68,350
未払：	
購入済みの投資資産	55,067
解約済み受益証券	13,542
専門家報酬	54,849
会計および管理会社報酬	7,450
保管会社報酬	7,214
運用会社報酬	5,841
登録料	810
名義書換代理人報酬	410
負債合計	213,533
純資産	\$ 7,132,552
純資産	
円ヘッジクラス	\$ 6,068,564
円ヘッジ／Ｎ１クラス	1,063,988
	\$ 7,132,552

発行済み受益証券

円ヘッジクラス	8,120,592
円ヘッジ／N 1 クラス	1,181,855

受益証券1口当り純資産額

円ヘッジクラス	\$	0.747
円ヘッジ／N 1 クラス	\$	0.900

損益計算書

2018年6月29日に終了する年度

投資収益

受取利息	\$	344,762
------	----	---------

投資収益合計

344,762

費用

専門家報酬	55,109
会計および管理会社報酬	45,000
保管会社報酬	39,386
運用会社報酬	34,494
受託会社報酬	22,949
名義書換代理人報酬	3,241
登録料	2,662

費用合計

202,841

投資純利益

141,921

実現益（損）および評価益（損）：**実現益（損）：**

証券投資	7,352
外国為替取引および外国為替先渡契約	(163,375)

純実現損

(156,023)

評価益（損）の純変動：

証券投資	(108,510)
外国為替換算および外国為替先渡契約	117,717

評価益（損）の純変動

9,207

実現益（損）および評価益（損）の純変動

(146,816)

運用による純資産の純減

\$ (4,895)

投資明細表
2018年6月29日

	元本	有価証券の明細	評価額
		債券（98.3%）	
		カナダ（4.8%）	
		バンクローン（1.7%）	
		MacDonald, Dettwiler and Associates Ltd.	
USD	79,600	4.85% due 2024/10/4	\$ 79,401
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	
USD	40,000	4.98% due 2025/6/2	39,917
		バンクローン合計	119,318

社債 (3.1%)			
		Bombardier, Inc.	
USD	85,000	8.75% due 2021/12/1 (a)	93,500
		First Quantum Minerals Ltd.	
USD	35,000	7.00% due 2021/2/15 (a),(b)	35,350
		NOVA Chemicals Corp.	
USD	70,000	5.25% due 2023/8/1 (a),(b)	69,825
		Teck Resources Ltd.	
USD	25,000	3.75% due 2023/2/1 (b)	23,719
社債合計			222,394
カナダ合計 (簿価 \$341,522)			341,712
ルクセンブルク (6.0%)			
バンクローン (1.7%)			
		JBS USA Lux S.A.	
USD	118,500	4.83% due 2022/10/30	117,759
バンクローン合計			117,759
社債 (4.3%)			
		ArcelorMittal	
USD	140,000	5.50% due 2021/3/1	145,880
		Intelsat Jackson Holdings S.A.	
USD	70,000	8.00% due 2024/2/15 (a),(b)	73,500
		Mallinckrodt International Finance S.A. / Mallinckrodt CB LLC	
USD	90,000	4.88% due 2020/4/15 (a),(b)	88,425
社債合計			307,805
ルクセンブルク合計 (簿価 \$429,232)			425,564
オランダ (0.0%)			
社債 (0.0%)			
		OI European Group BV	
USD	5,000	4.00% due 2023/3/15 (a),(b)	4,663
社債合計			4,663
オランダ合計 (簿価 \$5,000)			4,663
米国 (87.5%)			
バンクローン (18.2%)			
		Acadia Healthcare Company, Inc.	
USD	66,621	4.59% due 2023/2/16	66,906
		Apergy Corp.	
USD	5,000	4.56% due 2025/5/9	5,013
		Asurion LLC	
USD	51,183	4.84% due 2023/11/3	51,174
		B&G Foods, Inc.	
USD	91,552	4.09% due 2022/11/2	91,709
		California Resources Corp.	
USD	35,000	6.84% due 2022/12/31	35,711
		Caraustar Industries, Inc.	
USD	29,625	7.83% due 2022/3/14	29,839
		CCM Merger, Inc.	
USD	95,115	4.84% due 2021/8/6	95,333
		CSC Holdings LLC	
USD	40,000	4.57% due 2026/1/25	39,933
		DaVita, Inc.	
USD	155,544	4.84% due 2021/6/24	156,142
		DJO Finance LLC	
USD	39,391	5.45% due 2020/6/8	39,293
		Energizer Holdings, Inc.	
USD	30,000	0.00% due 2025/6/20 (c)	30,038
		Filtration Group Corp.	
USD	4,988	5.09% due 2025/3/29	4,994
		First Data Corp.	
USD	117,512	4.09% due 2022/7/8	117,144
		Genworth Holdings, Inc.	
USD	24,938	6.55% due 2023/3/7	25,436

		Golden Nugget, Inc.	
USD	4,950	4.82% due 2023/10/4	4,952
		Hub International Ltd.	
USD	20,000	5.36% due 2025/4/25	19,902
		IRB Holding Corp.	
USD	4,988	5.27% due 2025/2/5	5,002
		iStar, Inc.	
USD	90,573	5.01% due 2023/6/28	90,573
		Kinetic Concepts, Inc.	
USD	24,750	5.58% due 2024/2/2	24,816
		Lions Gate Capital Holdings LLC	
USD	69,825	4.34% due 2025/3/24	69,709
		Michaels Stores, Inc.	
USD	73,105	4.58% due 2023/1/30	72,648
		Post Holdings, Inc.	
USD	74,362	4.10% due 2024/5/24	74,026
		Prestige Brands, Inc.	
USD	10,614	4.09% due 2024/1/26	10,598
		Prime Security Services Borrower LLC	
USD	9,875	4.84% due 2022/5/2	9,840
		Russell Investments US Institutional Holdco, Inc.	
USD	93,275	5.34% due 2023/6/1	93,881
		Transdigm, Inc.	
USD	9,962	4.59% due 2024/8/22 (c)	9,904
		West Corp.	
USD	26,325	6.09% due 2024/10/10	26,269
		バンクローン合計	1,300,785
		社債 (69.3%)	
		ADT Corp.	
USD	75,000	6.25% due 2021/10/15	77,625
		Air 2 US	
USD	7,704	8.03% due 2019/10/1 (a)	8,089
		Aircastle Ltd.	
USD	100,000	5.13% due 2021/3/15	102,125
		AK Steel Corp.	
USD	75,000	7.63% due 2021/10/1 (b)	76,477
		Ally Financial, Inc.	
USD	80,000	4.25% due 2021/4/15	80,000
		AMC Networks, Inc.	
USD	35,000	4.75% due 2022/12/15 (b)	35,044
		American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust	
USD	151,651	5.63% due 2021/1/15 (a)	154,305
		Anixter, Inc.	
USD	75,000	5.13% due 2021/10/1	76,312
		Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp.	
USD	25,000	10.00% due 2022/4/1 (a),(b)	27,500
		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp.	
USD	150,000	5.25% due 2022/9/30 (b)	150,469
		Centene Corp.	
USD	110,000	5.63% due 2021/2/15 (b)	112,324
		CF Industries, Inc.	
USD	105,000	7.13% due 2020/5/1	110,906
		Chesapeake Energy Corp.	
USD	47,000	8.00% due 2022/12/15 (a),(b)	49,336
		CIT Group, Inc.	
USD	70,000	4.13% due 2021/3/9 (b)	69,562
		Clean Harbors, Inc.	
USD	35,000	5.13% due 2021/6/1 (b)	35,131
		Cleveland-Cliffs, Inc.	
USD	10,000	4.88% due 2024/1/15 (a),(b)	9,650
		Cloud Crane LLC	
USD	30,000	10.13% due 2024/8/1 (a),(b)	32,250

		CNO Financial Group, Inc.	
USD	90,000	4.50% due 2020/5/30	89,887
		Credit Acceptance Corp.	
USD	55,000	7.38% due 2023/3/15 (b)	56,787
		DAE Funding LLC	
USD	55,000	4.50% due 2022/8/1 (a),(b)	53,350
		DCP Midstream Operating LP	
USD	100,000	9.75% due 2019/3/15 (a)	104,125
		Dell International LLC / EMC Corp.	
USD	110,000	5.88% due 2021/6/15 (a),(b)	111,498
		DISH DBS Corp.	
USD	190,000	5.13% due 2020/5/1	188,100
		EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance, Inc.	
USD	50,000	7.75% due 2026/5/15 (a),(b)	51,125
USD	110,000	9.38% due 2024/5/1 (a),(b)	90,200
		Frontier Communications Corp.	
USD	35,000	7.13% due 2019/3/15	35,262
		GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc.	
USD	115,000	4.38% due 2021/4/15	115,000
		HCA Healthcare, Inc.	
USD	90,000	6.25% due 2021/2/15	93,375
		HCA, Inc.	
USD	205,000	3.75% due 2019/3/15	205,769
		Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp.	
USD	65,000	5.88% due 2022/2/1 (b)	65,081
USD	10,000	6.25% due 2022/2/1 (b)	10,200
		ILFC E-Capital Trust II	
USD	100,000	4.82% due 2065/12/21 (a),(b),(d)	92,500
		Indiantown Cogeneration LP	
USD	50,828	9.77% due 2020/12/15	55,052
		Iron Mountain, Inc.	
USD	100,000	4.38% due 2021/6/1 (a),(b)	99,844
		Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp.	
USD	55,000	6.75% due 2021/11/15 (a),(b)	56,650
		KB Home	
USD	130,000	7.00% due 2021/12/15 (b)	136,500
		L Brands, Inc.	
USD	75,000	5.63% due 2022/2/15	76,125
		Lennar Corp.	
USD	90,000	4.13% due 2018/12/1 (b)	90,045
		MasTec, Inc.	
USD	35,000	4.88% due 2023/3/15 (b)	33,885
		MGM Resorts International	
USD	105,000	6.63% due 2021/12/15	110,644
		NCL Corp. Ltd.	
USD	11,000	4.75% due 2021/12/15 (a),(b)	10,972
		Netflix, Inc.	
USD	110,000	5.38% due 2021/2/1	113,058
		NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp.	
USD	75,000	6.88% due 2021/10/15 (b)	75,937
		PHI, Inc.	
USD	35,000	5.25% due 2019/3/15 (b)	34,213
		Reynolds Group Issuer, Inc. / Reynolds Group Issuer LLC /	
		Reynolds Group Issuer Lu	
USD	29,073	5.75% due 2020/10/15 (b)	29,182
USD	100,000	5.85% due 2021/7/15 (a),(b),(d)	100,930
		RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp.	
USD	35,000	5.00% due 2021/4/15 (b)	35,088
		Sanmina Corp.	
USD	65,000	4.38% due 2019/6/1 (a)	65,000
		Service Corp. International	
USD	65,000	8.00% due 2021/11/15	72,313

		Sprint Capital Corp.	
USD	110,000	6.90% due 2019/5/1	112,222
		Sprint Communications, Inc.	
USD	175,000	7.00% due 2020/8/15	181,125
		Sunoco LP / Sunoco Finance Corp.	
USD	75,000	4.88% due 2023/1/15 (a),(b)	72,000
		Tenet Healthcare Corp.	
USD	55,000	6.00% due 2020/10/1	56,513
USD	10,000	7.50% due 2022/1/1 (a),(b)	10,400
		T-Mobile USA, Inc.	
USD	110,000	4.00% due 2022/4/15 (b)	108,878
		TRI Pointe Group, Inc.	
USD	55,000	4.88% due 2021/7/1 (b)	55,344
		Triumph Group, Inc.	
USD	80,000	5.25% due 2022/6/1 (b)	77,000
		Universal Hospital Services, Inc.	
USD	75,000	7.63% due 2020/8/15 (b)	74,813
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	
USD	135,000	6.75% due 2021/8/15 (a),(b)	136,519
		Weatherford International Ltd.	
USD	30,000	4.50% due 2022/4/15 (b)	27,536
		Whiting Petroleum Corp.	
USD	15,000	5.75% due 2021/3/15 (b)	15,330
		Williams Scotsman International, Inc.	
USD	25,000	7.88% due 2022/12/15 (a),(b)	25,875
		Yum! Brands, Inc.	
USD	225,000	3.88% due 2020/11/1 (b)	222,188
社債合計			4,940,545
米国合計 (簿価 \$6,309,645)			6,241,330
債券合計 (簿価 \$7,085,399)			\$ 7,013,269
短期投資 (3.6%)			
ケイマン諸島 (0.0%)			
定期預金 (0.0%)			
		Brown Brothers Harriman & Co.	
JPY	330,049	-0.22%* due 2018/7/2	2,980
定期預金合計			2,980
ケイマン諸島合計 (簿価 \$2,980)			2,980
米国 (3.6%)			
定期預金 (3.6%)			
		JPMorgan Chase & Co.	
USD	252,971	1.17% due 2018/7/2	252,971
定期預金合計			252,971
米国合計 (簿価 \$252,971)			252,971
短期投資合計 (簿価 \$255,951)			255,951
純資産に占める割合			
投資総額 (簿価 \$7,341,350)			101.9%
現金および他の資産を超過する負債			(1.9)
純資産			\$ 7,132,552

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

*日本の中央銀行による預金金利引き下げのため、日本円建ての短期投資の金利はゼロ%未満である可能性があります。

- (a) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家への転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は流動性がないとはみなされません。
- (b) 期前償還条項付き証券。
- (c) このポジションの全部または一部は、期末の未決済のローンコミットメントを表しています。この購入に関連する詳細（クーポンレートを含む）については、決済日以前には分かりません。
- (d) 2018年6月29日時点の変動金利証券。

2018年6月29日現在の円ヘッジクラスの外国為替先渡契約（純資産の-0.8%）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益/（損）
JPY	Barclays Bank Plc	685,053,796	2018/7/19	USD	6,249,521	\$ -	\$ (58,078)	\$ (58,078)
USD	Barclays Bank Plc	123,954	2018/7/19	JPY	13,715,733	-	(7)	(7)
						\$ -	\$ (58,085)	\$ (58,085)

2018年6月29日現在の円ヘッジ/N 1クラスの外国為替先渡契約（純資産の-0.1%）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益/（損）
JPY	Barclays Bank Plc	1,500,000	2018/7/3	USD	13,591	\$ -	\$ (49)	\$ (49)
JPY	Barclays Bank Plc	120,508,905	2018/7/19	USD	1,099,363	-	(10,216)	(10,216)
USD	Barclays Bank Plc	13,605	2018/7/19	JPY	1,500,000	49	-	49
						\$ 49	\$ (10,265)	\$ (10,216)

通貨の略称:

JPY - 日本円
USD - 米ドル

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年7月5日現在	平成31年1月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	47,755,811,859	48,760,880,290
流動資産合計	47,755,811,859	48,760,880,290
資産合計	47,755,811,859	48,760,880,290
負債の部		
流動負債		
未払解約金	560,000,000	2,280,000,000

その他未払費用	4,078,485	3,374,438
流動負債合計	564,078,485	2,283,374,438
負債合計	564,078,485	2,283,374,438
純資産の部		
元本等		
元本	1 47,068,665,883	46,378,927,395
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	123,067,491	98,578,457
元本等合計	47,191,733,374	46,477,505,852
純資産合計	47,191,733,374	46,477,505,852
負債純資産合計	47,755,811,859	48,760,880,290

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7月6日 至 平成31年1月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年7月5日現在	平成31年1月5日現在
1. 1 期首	平成29年7月6日	平成30年7月6日
期首元本額	29,899,452,061円	47,068,665,883円
期中追加設定元本額	70,321,736,532円	27,322,342,472円
期中一部解約元本額	53,152,522,710円	28,012,080,960円
期末元本額の内訳		

ファンド名		
ダイワ米国担保付貸付債権 ファンド（為替ヘッジあり）	3,021,993円	3,021,993円
ダイワ米国担保付貸付債権 ファンド（為替ヘッジなし）	1,018,149円	1,018,149円
ダイワ米国バンクローン・ ファンド（為替ヘッジあり）	9,963円	9,963円
2014-07		
ダイワ米国バンクローン・ ファンド（為替ヘッジあり）	9,963円	9,963円
2014-09		
ダイワ米国バンクローン・ ファンド（為替ヘッジあり）	9,962円	9,962円
2014-11		
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド - ロボテック -	947,268円	947,268円
ダイワノミレーアセット・イ ンド株式ファンド - インド の匠 -	29,910,270円	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命 ファンド（為替ヘッジあり）	998円	998円
ワールド・フィンテック革命 ファンド（為替ヘッジなし）	998円	998円
新興国ソブリン・豪ドルファ ンド（毎月決算型）	999円	999円
新興国ソブリン・ブラジルレ アルファンド（毎月決算型）	999円	999円
新興国ソブリン・ファンド （為替ヘッジあり／毎月決算 型）	999円	999円
U S 短期ハイ・イールド社債 ファンド（為替ヘッジあり／ 毎月決算型）	102,434円	102,434円
U S 短期高利回り社債ファン ド（為替ヘッジあり／年1回 決算型）	1,994円	1,994円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド - ロボテック - （為替ヘッジあり）	39,849円	39,849円

ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）	3,985円	3,985円
- ロボテック（年1回） - （為替ヘッジあり）		
iFreeレバレッジ S&P500	- 円	995,814円
ダイワ上場投信 - 日経平均レバレッジ・インデックス	6,010,926,951円	6,485,306,799円
ダイワ上場投信 - 日経平均ダブルインバース・インデックス	4,526,408,749円	4,037,758,084円
ダイワ上場投信 - TOPIXレバレッジ（2倍）指数	2,551,710,772円	1,573,910,825円
ダイワ上場投信 - TOPIXダブルインバース（-2倍）指数	642,415,250円	1,091,457,294円
ダイワ上場投信 - 日経平均インバース・インデックス	4,107,583,026円	4,257,298,590円
ダイワ上場投信 - TOPIXインバース（-1倍）指数	2,966,758,220円	7,377,045,613円
ダイワ上場投信 - J P X日経400レバレッジ・インデックス	363,434,650円	293,593,288円
ダイワ上場投信 - J P X日経400インバース・インデックス	2,308,214,689円	2,008,932,965円
ダイワ上場投信 - J P X日経400ダブルインバース・インデックス	205,180,620円	236,119,736円
ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-07	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-07	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2017-06	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2017-06	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-10	997円	997円

ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）	997円	997円
2016-10		
ダイワ日本株式ベア・ファンド（適格機関投資家専用）	8,756,491,695円	4,387,380,620円
低リスク型アロケーションファンド（金利トレンド判断付き／適格機関投資家専用）	199,401,795円	199,401,795円
ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - SLトレード -	56,086,003円	56,086,003円
ダイワ／モルガン・スタンレー新興４カ国不動産関連ファンド - 成長の槌音（つちおと） -	5,020,480円	5,020,480円
ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	173,072,094円	185,691,689円
ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ	164,830,427円	151,797,338円
低リスク型アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	13,958,125,625円	13,958,125,625円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド 豪ドル・コース（毎月分配型）	595,106円	595,106円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）	987,373円	987,373円
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド 通貨セレクト・コース（毎月分配型）	494,581円	494,581円
ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	9,957円	9,957円

ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	997円	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）	997円	997円
ダイワノミレーアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円	9,958,176円
<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり	49,806円	49,806円
<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし	49,806円	49,806円
通貨選択型ダイワノミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース	1,989,053円	1,989,053円
通貨選択型ダイワノミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース	2,978,118円	2,978,118円
通貨選択型ダイワノミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース	1,691,241円	1,691,241円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型） - ロボテック（年1回） -	100,588円	100,588円
ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり（毎月分配型）	399,083円	399,083円
ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし（毎月分配型）	99,771円	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース（毎月分配型）	399,083円	399,083円

通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース（毎月分配型）	99,771円	99,771円
ダイワノミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）	1,091,429円	1,091,429円
ダイワノミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジなし）	315,004円	315,004円
ダイワノミレーアセット・アジア・セクターリーダー株式ファンド	10,009,811円	10,009,811円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 日本円・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 豪ドル・コース（毎月分配型）	99,691円	99,691円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 米ドル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース（毎月分配型）	1,993,820円	1,993,820円

通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 日本 円・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 豪ド ル・コース	200,861円	200,861円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 ブラジ ル・リアル・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 米ド ル・コース	1,999,177円	1,999,177円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 通貨セ レクト・コース	505,900円	505,900円
計	47,068,665,883円	46,378,927,395円
2. 期末日における受益権の総数	47,068,665,883口	46,378,927,395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31年1月5日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	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7月5日現在	平成31年1月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成30年7月5日現在	平成31年1月5日現在
--	-------------	-------------

1口当たり純資産額	1.0026円	1.0021円
（1万口当たり純資産額）	(10,026円)	(10,021円)

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2019年1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。

2019年1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	164,657
追加型株式投資信託	715	14,961,679
株式投資信託 合計	795	15,126,336
単位型公社債投資信託	30	114,211
追加型公社債投資信託	14	1,402,192
公社債投資信託 合計	44	1,516,404
総合計	839	16,642,740

(3) 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

5 【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第60期事業年度に係る中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

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

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成29年 3月31日）	当事業年度 （平成30年 3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

中期報告書（内閣投資信託）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

（5年間）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

（3）役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成29年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

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

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

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

平成30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設

けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されており、

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

（３）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	31,260	31,260	-
（２）未収委託者報酬	10,453	10,453	-
（３）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
（１）未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
（２）その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
（３）未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（平成30年３月31日）

（単位：百万円）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

（注１）金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

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

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	122	55	67
（2）その他 証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	1,829	1,926	96

小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	50	-	1
（２）その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,685	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40円

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位: 百万円)

		当中間会計期間 (2018年 9 月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,097
有価証券		0
未収委託者報酬		12,445
その他		2,329
流動資産合計		35,872
固定資産		
有形固定資産	1	199
無形固定資産		
ソフトウェア		2,162
その他		449
無形固定資産合計		2,612
投資その他の資産		
投資有価証券		7,521
関係会社株式		1,836
繰延税金資産		964
その他		1,286
投資その他の資産合計		11,608
固定資産合計		14,420
資産合計		50,293

(単位: 百万円)

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

未払法人税等	859
賞与引当金	611
その他	2 552
流動負債合計	12,855
固定負債	
退職給付引当金	2,335
役員退職慰労引当金	144
その他	3
固定負債合計	2,483
負債合計	15,338
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,643
利益剰余金合計	8,017
株主資本合計	34,687
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	34,955
負債・純資産合計	50,293

(2) 中間損益計算書

(単位: 百万円)

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

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414
会計方針の変更による累積的影響額				480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
中間純利益	-	-	-	6,462	6,462	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,207	6,207	6,207
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,643	8,017	34,687

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	40,631
会計方針の変更による累積的影響額			480
会計方針の変更を反映した当期首残高			41,112
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
中間純利益	-	-	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	50	50	50
当中間期変動額合計	50	50	6,156
当中間期末残高	267	267	34,955

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

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

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

（中間貸借対照表関係）

１ 減価償却累計額

当中間会計期間

（2018年9月30日現在）

有形固定資産	280百万円
--------	--------

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

3 保証債務

当中間会計期間（2018年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,743百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	436百万円

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

4 特別損失の主要項目

当中間会計期間

（自 2018年 4 月 1 日

至 2018年 9 月30日）

関係会社整理損失

29百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2018年 4 月 1 日 至 2018年 9 月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2018年 9 月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	21,097	21,097	-
(2) 未収委託者報酬	12,445	12,445	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,551	6,551	-
資産合計	40,094	40,094	-
(1) 未払金	(7,096)	(7,096)	-
(2) 未払費用(*2)	(3,089)	(3,089)	-
負債合計	(10,186)	(10,186)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

（注１）金融商品の時価の算定方法

資 産

（１）現金・預金及び（２）未収委託者報酬

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

（３）有価証券及び投資有価証券

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

負 債

（１）未払金及び（２）未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	1,836
差入保証金	1,071

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2018年9月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

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

２．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	129	55	74
（２）その他			

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

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

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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

〔関連情報〕

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
1株当たり純資産額	13,400.41円
1株当たり中間純利益	2,477.30円

（注1）潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注2）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
中間純利益(百万円)	6,462
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,462
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成31年2月15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US短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）の平成30年7月6日から平成31年1月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）の平成31年1月5日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年7月6日から平成31年1月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) ２． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。