

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2020年2月7日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
（2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社（予定））

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松下 浩一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 西脇 保宏
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算
型）
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成
型）

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 (1) 当初自己設定
各ファンドについて100万円とし、合計で200万円としま
す。
(2) 継続申込期間
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で20兆円を
上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年10月15日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（2019年11月末日現在）>

<略>

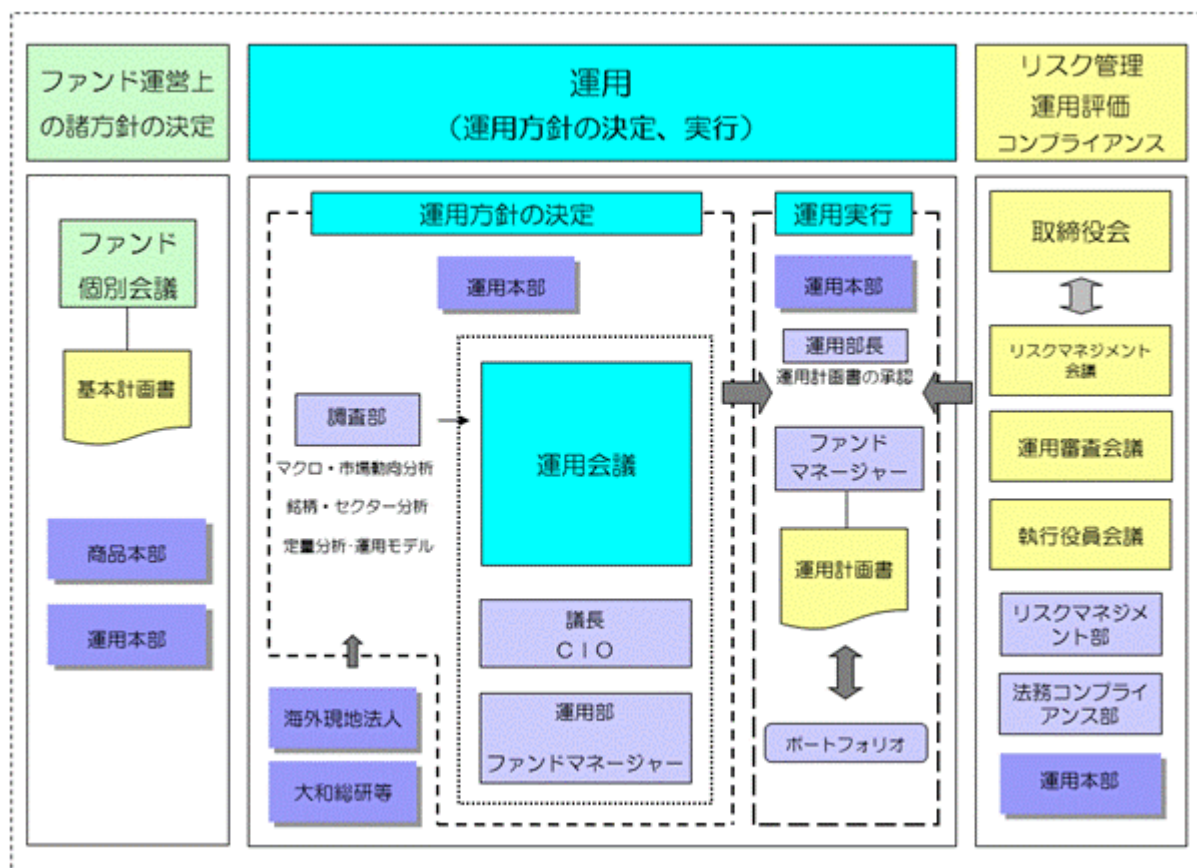
2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

< 略 >

運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ロ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

< 略 >

上記の運用体制は2019年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

3 【投資リスク】

< 更新後 >

< 略 >

参考情報

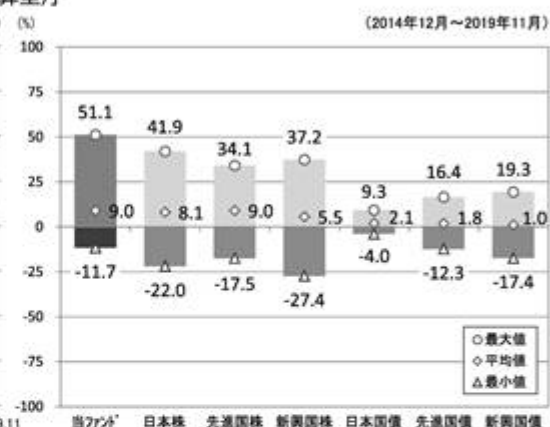
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

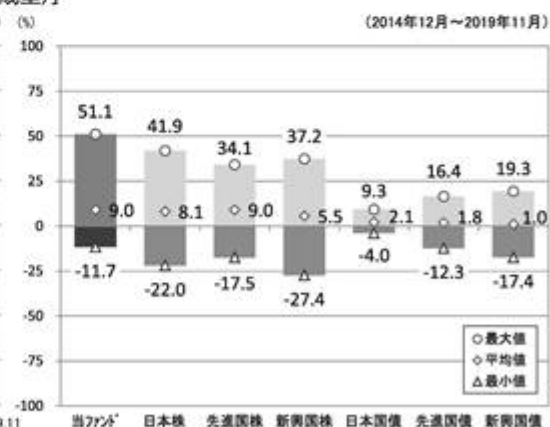
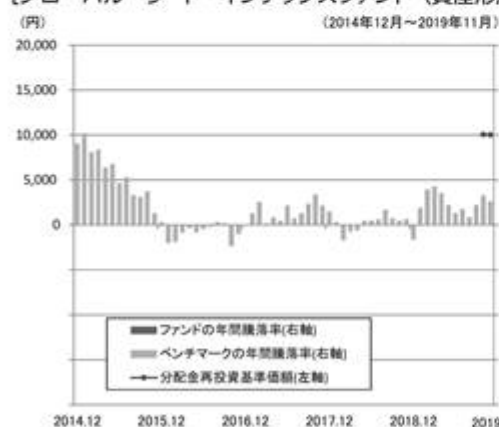
【グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)】



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日 本 株: 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
先進国株: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
新興国株: MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
日本国債: NOMURA-BPI国債
先進国債: FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
新興国債: JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2019年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1 213	1 206

建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

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

負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13

その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

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

法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）其他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

（3）役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

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

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

（損益計算書）

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数

発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

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

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-

(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 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。

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)

(1) 其他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

2. 其他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他			
証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

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

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389

貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
-------------------------	-------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(2018年3月31日)	(2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡 益)	159	159
その他有価証券評価差 額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行

う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引(譲渡益)は480百万円減少しております。

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

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注1)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資 (注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けておりません。

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
----	--------	-----	--------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	-----------------------	----	-----------------------

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81円

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

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
固定資産		
有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
投資その他の資産		

投資有価証券	7,928
関係会社株式	2,664
繰延税金資産	1,205
その他	1,280
投資その他の資産合計	13,078
固定資産合計	16,073
資産合計	47,886

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2019年9月30日)

負債の部

流動負債

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

流動負債合計	11,243
--------	--------

固定負債

退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7

固定負債合計	2,619
--------	-------

負債合計

負債合計	13,862
------	--------

純資産の部

株主資本

資本金	15,174
-----	--------

資本剰余金

資本準備金	11,495
-------	--------

資本剰余金合計	11,495
---------	--------

利益剰余金

利益準備金	374
-------	-----

その他利益剰余金

繰越利益剰余金	6,968
---------	-------

利益剰余金合計	7,343
---------	-------

株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	1	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	2	968
営業外費用	3	148
経常利益		8,083
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		15
中間純利益		5,785

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) 其他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

当中間会計期間

(2019年9月30日現在)

有形固定資産	310百万円
--------	--------

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数

発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年3月31 日	2019年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金	19,529	19,529	-
(2)未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1)未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2)未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1)金融商品の時価の算定方法

資 産

(1)現金・預金及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 1,836百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 827百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344

小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1.サービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）】

(1) 【投資状況】（2019年11月29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	1,002,817	99.99
内 日本	1,002,817	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	99	0.01
純資産総額	1,002,916	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2019年11月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	386,949	2.5826 999,342	2.5916 1,002,817	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
2019年10月末日	1,006,465	-	1.0065	-
11月末日	1,002,916	-	1.0029	-

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

該当事項はありません。

(4) 【設定及び解約の実績】

該当事項はありません。

(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 (2019年11月29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	558,290,370	2.05
内 アメリカ	558,290,370	2.05
投資証券	25,912,670,593	94.95
内 ガーンジー	51,334,102	0.19
内 マン島	7,394,986	0.03
内 韓国	4,552,590	0.02
内 香港	508,623,640	1.86
内 シンガポール	1,060,991,046	3.89
内 イスラエル	20,167,812	0.07
内 イギリス	1,336,671,849	4.90
内 アイルランド	32,421,466	0.12
内 オランダ	65,796,273	0.24
内 ベルギー	248,792,365	0.91
内 フランス	869,740,096	3.19
内 ドイツ	67,018,860	0.25
内 スペイン	160,227,929	0.59
内 イタリア	4,800,833	0.02
内 カナダ	524,372,242	1.92
内 アメリカ	19,058,495,849	69.84
内 オーストラリア	1,782,352,631	6.53
内 ニュージーランド	108,916,024	0.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	818,508,336	3.00

純資産総額	27,289,469,299	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)	796,754,822	2.92
内 ドイツ	192,805,322	0.71
内 アメリカ	603,949,500	2.21
為替予約取引(買建)	636,980,900	2.33
内 日本	636,980,900	2.33

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

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

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

(2) 投資資産 (2019年11月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	110,302	7,570.59 835,058,142	10,123.34 1,116,625,090	4.09
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	14,800	62,005.04 917,675,108	61,922.21 916,448,803	3.36
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	53,847	19,744.24 1,063,174,053	16,567.66 892,118,960	3.27
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	70,800	8,092.53 572,954,691	9,402.43 665,692,695	2.44
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	26,200	23,599.88 618,317,538	23,239.86 608,884,521	2.23
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,400	20,871.94 509,277,871	23,617.84 576,275,520	2.11
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	60,900	7,852.27 478,205,122	9,381.62 571,340,829	2.09
8	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	54,500	10,213.29 556,628,345	10,243.86 558,290,370	2.05
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	36,478	12,540.45 457,452,444	13,278.67 484,379,397	1.77
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	55,617	7,177.16 399,175,902	8,511.71 473,396,131	1.73
11	LINK REIT	香港	投資証券	387,500	1,096.80 425,012,385	1,134.00 439,425,000	1.61
12	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	65,179	6,929.23 451,644,178	6,432.26 419,248,770	1.54
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,567	29,150.95 337,189,282	34,287.89 396,608,112	1.45
14	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	23,200	18,353.91 425,813,282	17,093.63 396,572,274	1.45
15	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	25,200	14,195.25 357,722,559	15,229.93 383,794,377	1.41

16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	19,800	13,860.87 274,445,390	17,782.68 352,097,135	1.29
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	86,000	3,227.30 277,555,519	3,845.55 330,717,816	1.21
18	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	296,450	841.41 249,447,426	1,092.82 323,967,556	1.19
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	20,028	11,500.18 230,326,877	15,021.77 300,856,042	1.10
20	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	15,900	12,010.51 190,967,232	18,109.17 287,935,841	1.06
21	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	985,270	295.44 291,119,639	291.37 287,078,317	1.05
22	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	82,897	2,637.54 218,650,529	3,325.14 275,644,628	1.01
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	29,600	7,758.71 229,658,029	9,273.15 274,485,489	1.01
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	50,700	4,658.71 236,199,002	5,262.16 266,791,857	0.98
25	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	22,300	10,597.84 236,333,892	11,636.36 259,490,997	0.95
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	31,500	5,565.10 175,302,223	8,086.62 254,728,643	0.93
27	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	126,400	2,076.38 262,460,982	1,944.69 245,808,816	0.90
28	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	193,210	907.11 175,272,554	1,263.43 244,107,581	0.89
29	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	62,600	3,137.25 196,398,653	3,865.27 241,966,328	0.89
30	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	79,800	2,410.86 192,389,866	2,726.94 217,610,482	0.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	2.05%
投資証券	94.95%
合計	97.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2019年12月	買建	150	609,904,086	603,949,500	2.21%

	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2019年12月	買建	170	181,588,582	192,805,322	0.71%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2019年12月	買建	1,230,000	148,137,737	148,313,400	0.54%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2019年12月	買建	50,000	3,471,870	3,513,000	0.01%
		米ドル買/円売 2019年12月	買建	4,340,000	468,503,998	475,230,000	1.74%
		カナダ・ドル買/円売 2019年12月	買建	50,000	4,097,637	4,120,500	0.02%
		豪ドル買/円売 2019年12月	買建	50,000	3,699,040	3,705,500	0.01%
		香港ドル買/円売 2019年12月	買建	150,000	2,089,710	2,098,500	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

【グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)】

(1) 【投資状況】(2019年11月29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	1,002,817	99.99
内 日本	1,002,817	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	99	0.01
純資産総額	1,002,916	100.00

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

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

(2) 【投資資産】(2019年11月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	386,949	2.5130 972,404	2.5916 1,002,817	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
2019年10月末日	1,006,465	-	1.0065	-
第1特定期間末 (2019年11月14日)	972,788	972,788	0.9728	0.9728
11月末日	1,002,916	-	1.0029	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	0	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(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「グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)」の記載と同じ。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

●グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

2019年11月29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	10,029円
純資産総額	1百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.4%
3カ月間	-
6カ月間	-
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	0.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期													
	19年11月													
分配金	0円													

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

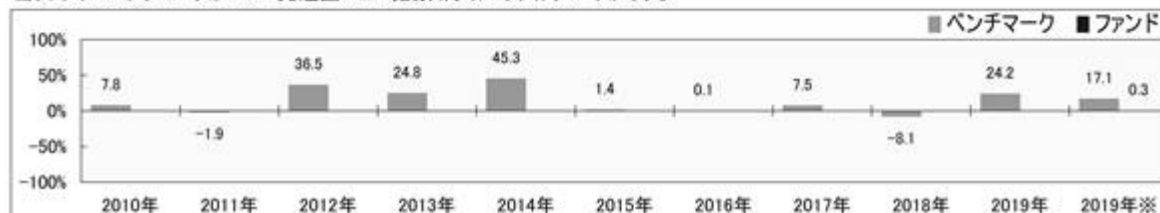
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	305	97.8%	米ドル	74.2%	商業施設	19.6%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	4.1%
外国投資信託等	3	2.2%	豪ドル	6.5%	住宅	14.5%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	3.4%
コール・ローン、その他		3.0%	ユーロ	6.0%	オフィス	11.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.3%
合計	308	-	英ポンド	5.1%	産業施設	11.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.7%	各種不動産	11.0%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.2%
アメリカ		74.1%	香港ドル	2.0%	ヘルスケア	9.5%	DJ US REAL ESTATE 201912	-	アメリカ	2.2%
オーストラリア		6.5%	カナダ・ドル	1.9%	特殊用途施設	8.8%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
イギリス		4.9%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	5.1%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.1%
シンガポール		3.9%	イスラエル・シケル	0.1%	ホテル/リゾート	3.6%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.0%
その他		10.5%	その他	0.0%			DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	1.8%
合計		99.9%	合計	100.0%	合計	94.8%	合計			25.6%

※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。



※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。

※2019年は11月29日まで、2019年※は設定日(10月31日)から11月29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。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) 運用実績

●グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

2019年11月29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	10,029円
純資産総額	1百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.4%
3カ月間	-
6カ月間	-
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	0.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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
分配金		

※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を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。

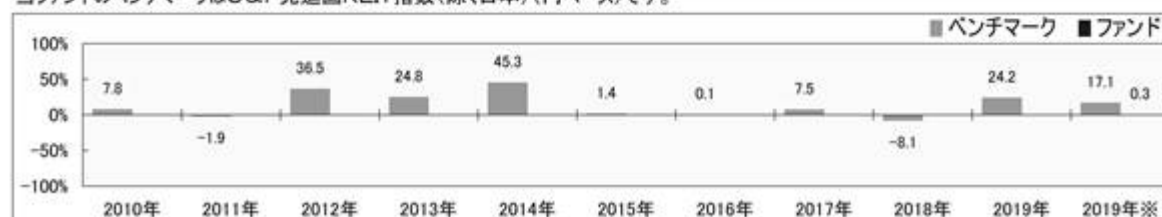
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	305	97.8%	米ドル	74.2%	商業施設	19.6%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	4.1%
外国投資信託等	3	2.2%	豪ドル	6.5%	住宅	14.5%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	3.4%
コール・ローン、その他		3.0%	ユーロ	6.0%	オフィス	11.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.3%
合計	308	-	英ポンド	5.1%	産業施設	11.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.7%	各種不動産	11.0%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.2%
アメリカ		74.1%	香港ドル	2.0%	ヘルスケア	9.5%	DJ US REAL ESTATE 201912	-	アメリカ	2.2%
オーストラリア		6.5%	カナダ・ドル	1.9%	特殊用途施設	8.8%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
イギリス		4.9%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	5.1%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.1%
シンガポール		3.9%	イスラエル・シケル	0.1%	ホテル/リゾート	3.6%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.0%
その他		10.5%	その他	0.0%			DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	1.8%
合計	99.9%		合計	100.0%	合計	94.8%	合計			25.6%

※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。



※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。

※2019年は11月29日まで、2019年※は設定日(10月31日)から11月29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。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2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、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 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、当特定期間（2019年10月31日から2019年11月14日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 財務諸表

【グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）】

(1) 【貸借対照表】

	当 期	
	2019年11月14日現在	
	金 額 (円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		330
親投資信託受益証券		972,724
流動資産合計		973,054
資産合計		973,054
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		3
未払委託者報酬		249
その他未払費用		14
流動負債合計		266
負債合計		266
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2	27,212
(分配準備積立金)		2,773
元本等合計		972,788
純資産合計		972,788
負債純資産合計		973,054

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	当 期	
	自 2019年10月31日 至 2019年11月14日	
	金 額 (円)	
営業収益		
有価証券売買等損益		26,946
営業収益合計		26,946
営業費用		
受託者報酬		3
委託者報酬		249
その他費用		14
営業費用合計		266
営業損失 ()		27,212
経常損失 ()		27,212
当期純損失 ()		27,212
分配金	1	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		27,212

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2019年10月31日	至 2019年11月14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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間 当ファンドの当特定期間は、2019年10月31日から2019年11月14日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	当 期	
	2019年11月14日現在	
1. 1 期首元本額	1,000,000円	
期中追加設定元本額	- 円	
期中一部解約元本額	- 円	
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,000,000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27,212円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2019年10月31日	至 2019年11月14日
1 分配金の計算過程	(自2019年10月31日 至2019年11月14日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,773円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は2,773円(1万口当たり27.73円)であり、分配を行っておりません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期	
	自 2019年10月31日	至 2019年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 2019年11月14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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	当 期 2019年11月14日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,942
合計	26,942

(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

当 期 2019年11月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期 自 2019年10月31日 至 2019年11月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当 期 2019年11月14日現在
1口当たり純資産額	0.9728円

(1万口当たり純資産額)

(9,728円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	387,077	972,724	
親投資信託受益証券 合計			972,724	
合計			972,724	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(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、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、当ファンドの特定期間末日(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。

[次へ](#)

「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

	2019年11月14日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		69,778,900
コール・ローン		600,632,760
投資信託受益証券		472,553,669
投資証券		24,805,774,797
派生商品評価勘定		10,930,533
未収入金		4,190,652
未収配当金		43,063,724
差入委託証拠金		106,069,713
流動資産合計		26,112,994,748
資産合計		26,112,994,748
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		20,551,941
未払金		79,250,715
未払解約金		3,628,600
その他未払費用		366
流動負債合計		103,431,622
負債合計		103,431,622
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,349,955,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		15,659,607,709
元本等合計		26,009,563,126
純資産合計		26,009,563,126
負債純資産合計		26,112,994,748

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年10月31日 至 2019年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</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。 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、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		2019年11月14日現在
1.	1 期首	2019年10月31日
	期首元本額	10,250,825,390円
	期中追加設定元本額	143,870,159円

期中一部解約元本額	44,740,132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)	4,758,621,896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)	711,893,196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)	327,918,705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)	229,570,088円
D-I's グローバルREITインデックス	1,221,504円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	233,283円
iFree 外国REITインデックス	100,110,628円
iFree 8資産バランスグローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	834,046,158円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	387,077円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,190,868,951円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	2,660,920円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,325,967円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,953,546円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	242,076,128円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	34,468,179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)	693,981,364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)	213,230,750円
計	10,349,955,417円
2. 期末日における受益権の総数	10,349,955,417口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年10月31日 至 2019年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年11月14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	<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)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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年11月14日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券	9,640,566	
投資証券	1,988,530,791	
合計	1,978,890,225	

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年12月1日から2019年11月14日まで）を指しております。

（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	2019年11月14日 現在			
	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	763,472,151	-	751,209,910	12,262,241
合計	763,472,151	-	751,209,910	12,262,241

(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	2019年11月14日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	632,407,167	-	635,048,000	2,640,833
アメリカ・ドル	482,296,122	-	485,800,400	3,504,278
イギリス・ポンド	6,990,040	-	6,986,000	4,040
オーストラリア・ドル	8,914,309	-	8,881,200	33,109
カナダ・ドル	3,286,880	-	3,280,000	6,880
シンガポール・ドル	12,808,648	-	12,755,200	53,448
ユーロ	118,111,168	-	117,345,200	765,968
合計	632,407,167	-	635,048,000	2,640,833

(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）

	2019年11月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5130円 (25,130円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	47,500.000	アメリカ・ドル 4,342,925.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 4,342,925.000 (472,553,669)	
投資信託受益証券 合計				472,553,669 [472,553,669]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,300	555,047.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	103,298.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	19,582	403,780.840	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,100	396,134.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,200	5,120,478.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	53,247	8,218,141.980	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,900	3,404,079.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,367	1,360,685.880	
		VORNADO REALTY TRUST	27,464	1,781,589.680	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12,100	275,154.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,200	331,500.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,700	174,677.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	9,400	481,562.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,400	5,126,148.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,200	580,648.000	
		EPR PROPERTIES	13,200	952,644.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	41,020.000	
		CITY OFFICE REIT INC	9,300	122,295.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	15,133	294,488.180	
		EQUINIX INC	14,600	7,894,658.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,829	322,576.830	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,400	130,092.000	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,700	244,530.000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,800	766,920.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,700	353,615.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	133,371.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	37,428.300	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	126,400	2,129,840.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,408	1,131,646.560	
		CORESITE REALTY CORP	6,400	726,080.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,300	915,766.000	
		RLJ LODGING TRUST	29,371	482,271.820	
		FARMLAND PARTNERS INC	2,900	19,778.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,900	584,727.000			
CYRUSONE INC	19,300	1,240,990.000			
KIMCO REALTY CORP	71,900	1,513,495.000			

GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,700	46,287.000
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	34,950	1,020,540.000
WHITESTONE REIT	5,800	79,750.000
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,700	1,473,882.500
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	488,838.000
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,880	920,208.800
COLONY CAPITAL INC	83,511	405,028.350
INVITATION HOMES INC	82,897	2,472,817.510
JBG SMITH PROPERTIES	20,132	786,959.880
CLIPPER REALTY INC	1,400	13,020.000
GLADSTONE LAND CORP	2,500	30,325.000
AMERICOLD REALTY TRUST	32,700	1,151,367.000
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,500	223,335.000
VICI PROPERTIES INC	79,800	1,943,130.000
RETAIL VALUE INC	2,709	99,230.670
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	236,500.000
BRT APARTMENTS CORP	1,300	22,360.000
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,300	78,840.000
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,900	155,762.000
SAFEHOLD INC	1,300	46,046.000
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	128,828.000
AMERICAN FINANCE TRUST INC	18,100	264,441.000
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,500	331,375.000
CORECIVIC INC	21,424	334,642.880
COREPOINT LODGING INC	6,700	65,928.000
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,300	22,750.000
STORE CAPITAL CORP	36,400	1,450,176.000
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,800	212,354.000
LIFE STORAGE INC	7,900	852,173.000
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,900	368,930.000
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,182	234,153.540
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,600	85,536.000
PARAMOUNT GROUP INC	36,300	489,324.000
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,700	363,398.000
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,700	863,940.000
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,100	427,275.000
STAG INDUSTRIAL INC	22,600	692,238.000
VENTAS INC	64,479	3,789,430.830
CARETRUST REIT INC	17,203	335,458.500
GEO GROUP INC/THE	20,900	303,677.000
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,700	1,106,781.000
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,700	246,169.000
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,887	746,534.900
UMH PROPERTIES INC	5,600	84,728.000
IRON MOUNTAIN INC	48,900	1,595,607.000
TERRENO REALTY CORP	11,400	632,130.000
VEREIT INC	180,008	1,697,475.440
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,720	781,912.800
SUN COMMUNITIES INC	15,700	2,468,040.000
ACADIA REALTY TRUST	14,911	409,157.840
ALEXANDER'S INC	400	130,020.000
PROLOGIS INC	109,002	9,584,545.860
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,600	3,069,360.000
BRANDYWINE REALTY TRUST	30,300	459,348.000
SAUL CENTERS INC	1,700	87,210.000
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	33,499.700
MACK-CALI REALTY CORP	15,600	332,748.000
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,800	1,860,264.000
COUSINS PROPERTIES INC	25,006	983,736.040
SITE CENTERS CORP	24,078	349,612.560

DUKE REALTY CORP	62,600	2,180,984.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,600	864,006.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,367	3,559,803.390
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,500	895,475.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,900	1,552,712.000
GETTY REALTY CORP	5,703	188,655.240
WELLTOWER INC	70,200	5,833,620.000
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	85,000	2,882,350.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,700	814,200.000
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,000	651,560.000
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,000	703,340.000
EQUITY COMMONWEALTH	20,775	663,969.000
KILROY REALTY CORP	15,800	1,302,078.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	27,300	1,617,798.000
LTC PROPERTIES INC	7,200	332,352.000
LEXINGTON REALTY TRUST	42,200	457,026.000
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,728	2,656,375.200
MACERICH CO/THE	19,100	521,239.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,500	2,143,890.000
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,400	587,856.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	29,300	1,630,838.000
REALTY INCOME CORP	55,117	4,234,087.940
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,300	559,314.000
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	49,020.000
PUBLIC STORAGE	26,000	5,503,680.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,400	593,096.000
REGENCY CENTERS CORP	29,020	1,877,303.800
RPT REALTY	13,800	201,066.000
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,100	240,845.000
SL GREEN REALTY CORP	14,000	1,187,620.000
SENIOR HOUSING PROP TRUST	41,000	312,830.000
TAUBMAN CENTERS INC	10,500	366,450.000
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,400	105,248.000
UDR INC	50,700	2,417,883.000
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,200	258,236.000
WP CAREY INC	29,600	2,508,896.000
WASHINGTON REIT	13,800	418,140.000
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,600	638,806.000
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	30,736.000
AGREE REALTY CORP	7,400	548,784.000
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,848	1,521,453.920
CUBESMART	32,800	1,013,520.000
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,326	528,132.280
DIGITAL REALTY TRUST INC	36,078	4,189,738.140
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	29,592.000
EXTRA SPACE STORAGE INC	22,300	2,349,528.000
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	73,006.000
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	152,913.800
KITE REALTY GROUP TRUST	13,350	243,904.500
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,000	251,260.000
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	59,576.000
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,400	1,089,036.000
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	106,925.000
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,342	365,963.940
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	76,000	1,498,720.000
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,300	139,365.000
DOUGLAS EMMETT INC	28,100	1,211,953.000
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,800	505,632.000
MANULIFE US REAL ESTATE INV	241,462	225,766.970
ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	75,508.000

アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 168,043,955.790 (18,284,862,829)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	ASSURA PLC	413,930	295,132.090
	CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	15,647.280
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	99,570	93,794.940
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	142,710	123,158.730
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	88,110	80,268.210
	REGIONAL REIT LTD	81,310	87,814.800
	NEWRIVER REIT PLC	51,330	94,241.880
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100,490	88,632.180
	LXI REIT PLC	94,038	118,675.950
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	47,267.100
	AEW UK REIT PLC	25,610	24,636.820
	RDI REIT PLC	41,036	52,936.440
	LAND SECURITIES GROUP PLC	132,041	1,168,562.850
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	70,790	71,781.060
	SEGRO PLC	190,610	1,608,748.400
	HAMMERSON PLC	133,920	367,476.480
	UNITE GROUP PLC/THE	50,520	583,506.000
	BRITISH LAND CO PLC	165,490	920,455.380
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	44,391	342,254.610
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	54,888.450
	DERWENT LONDON PLC	18,690	657,140.400
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213,440	300,096.640
	WORKSPACE GROUP PLC	21,760	238,054.400
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,390	263,827.500
	SHAFTESBURY PLC	37,380	342,213.900
	BIG YELLOW GROUP PLC	27,810	321,205.500
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	154,340	361,772.960
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	67,244.800
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	296,770	445,451.770
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 9,236,887.520 (1,291,409,244)
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル
	REIT 1 LTD	28,840	611,408.000
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 611,408.000 (19,033,131)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47,520	169,171.200
	CROMWELL PROPERTY GROUP	338,284	429,620.680
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	88,035.300
	VIVA ENERGY REIT	76,330	200,747.900
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	53,595	286,197.300
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	46,950	144,136.500
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	3,152	535.840
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	152,860	405,079.000
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	45,547	193,119.280
	NATIONAL STORAGE REIT	135,195	252,814.650
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	87,792.000
	GDI PROPERTY GROUP	83,310	127,464.300
	SCENTRE GROUP	971,270	3,749,102.200
	ARENA REIT	59,890	171,285.400
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	68,799.000
	BWP TRUST	90,550	367,633.000

	DEXUS	195,220	2,262,599.800
	GPT GROUP	347,110	2,047,949.000
	CHARTER HALL RETAIL REIT	59,400	260,766.000
	MIRVAC GROUP	713,040	2,274,597.600
	STOCKLAND	442,420	2,159,009.600
	ABACUS PROPERTY GROUP	64,120	246,862.000
	GOODMAN GROUP	291,950	4,177,804.500
	VICINITY CENTRES	584,590	1,519,934.000
	CHARTER HALL GROUP	82,960	886,012.800
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,220	195,350.400
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 22,772,419.250 (1,686,525,369)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	152,353.000
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18,400	308,016.000
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	39,804.000
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	151,536.000
	SLATE OFFICE REIT	5,100	30,345.000
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	95,970.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	10,200	121,890.000
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10,700	135,355.000
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,200	29,400.000
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,600	308,200.000
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,400	127,558.000
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,400	167,752.000
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,400	364,968.000
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	78,876.000
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	179,571.000
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,600	398,664.000
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,100	751,812.000
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	232,541.500
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,066	565,110.880
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,600	725,604.000
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	157,518.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,700	165,094.000
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,900	145,040.000
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,500	101,985.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	545,598.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 6,080,561.380 (499,274,895)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	220,083	424,760.190
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81,200	82,012.000
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	369,000	428,040.000
	AIMS APAC REIT	89,000	126,380.000
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	85,869.000
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271,650	331,413.000
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	74,416	18,683.020
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	71,810.000
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	520,575	1,041,150.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	465,100	1,358,092.000
	CAPITALAND MALL TRUST	511,500	1,263,405.000
	SUNTEC REIT	419,400	763,308.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	528,000	860,640.000
	KEPPEL REIT	343,400	412,080.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	129,960	207,936.000
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	213,600	281,952.000

	ESR-REIT	374,902	194,949.040	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	157,600	249,008.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	130,668	350,190.240	
	STARHILL GLOBAL REIT	243,800	177,974.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	145,396	222,455.880	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,300	216,216.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	65,464.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,580	678,478.400	
	CACHE LOGISTICS TRUST	174,500	123,022.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	395,284	889,389.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	129,291.000	
	SPH REIT	124,600	138,306.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	112,100	53,808.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	55,980.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148,900	160,812.000	
	OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	436,063	231,113.390	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 11,693,987.660 (933,297,156)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	222,720.600	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	273,920	421,836.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56,800	148,816.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	188,250	389,677.500	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190,240	337,676.000	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,520,726.900 (105,964,251)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,600	436,240.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	114,600.680	
	WERELDHAVE NV	6,470	134,576.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,200	3,318,760.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,530	177,093.600	
	NSI NV	3,231	131,824.800	
	VASTNED RETAIL NV	2,450	68,600.000	
	ICADE	4,560	389,652.000	
	ALTAREA	540	104,328.000	
	GECINA SA	9,241	1,396,315.100	
	KLEPIERRE	35,240	1,157,281.600	
	COVIVIO	7,562	765,274.400	
	MERCIALYS	4,030	48,803.300	
	AEDIFICA	4,144	464,128.000	
	COFINIMMO	4,070	531,542.000	
	BEFIMMO	3,720	215,388.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	90,859.500	
	RETAIL ESTATES	1,140	99,864.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,920	480,048.000	
	MONTEA	1,650	130,350.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	37,252.800	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	82,555.200	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	39,553	460,396.920	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	61,770	793,744.500	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58,050	98,917.200	
	GREEN REIT PLC	111,570	213,544.980	
HIBERNIA REIT PLC	116,240	159,248.800		
ユーロ 小計			ユーロ 12,101,189.380 (1,448,875,404)	

韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 52,020,000.000
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 52,020,000.000 (4,843,062)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287,000	香港・ドル 1,486,660.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	986,230.000
	FORTUNE REIT	245,000	2,214,800.000
	PROSPERITY REIT	195,000	575,250.000
	LINK REIT	383,500	31,101,850.000
	CHAMPION REIT	375,000	1,886,250.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 38,251,040.000 (531,689,456)
投資証券 合計			24,805,774,797 [24,805,774,797]
合計			25,278,328,466 [25,278,328,466]

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率	
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券	1銘柄 156銘柄	2.5%	97.5%	74.2%
イギリス・ポンド	投資証券	29銘柄	-%	100%	5.1%
イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	26銘柄	-%	100%	6.7%
カナダ・ドル	投資証券	25銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券	32銘柄	-%	100%	3.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券	27銘柄	-%	100%	5.7%
韓国・ウォン	投資証券	1銘柄	-%	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	-%	100%	2.1%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

【純資産額計算書】

2019年11月29日

資産総額	1,003,467円
負債総額	551円
純資産総額(-)	1,002,916円
発行済数量	1,000,000口
1単位当たり純資産額(/)	1.0029円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2019年11月29日

資産総額	27,385,599,866円
負債総額	96,130,567円
純資産総額(-)	27,289,469,299円
発行済数量	10,529,784,521口
1単位当たり純資産額(/)	2.5916円

グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

純資産額計算書

2019年11月29日

資産総額	1,003,201円
負債総額	285円
純資産総額(-)	1,002,916円
発行済数量	1,000,000口
1単位当たり純資産額(/)	1.0029円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)」の記載と同じ。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

二．運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2019年11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	62	115,488
追加型株式投資信託	721	16,485,415
株式投資信託 合計	783	16,600,903
単位型公社債投資信託	27	88,797
追加型公社債投資信託	14	1,478,400
公社債投資信託 合計	41	1,567,197
総合計	824	18,168,100

4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

独立監査人の監査報告書

2019年12月13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」に掲げられているグローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2019年10月31日から2019年11月14日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2019年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況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

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中

間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注)2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。