

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年6月5日提出
【計算期間】	第9計算期間 (自 2019年9月14日 至 2020年3月13日)
【ファンド名】	ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック -
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、日本を含む世界のロボット関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式 一般））
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

##### (注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「株式 一般」…大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年2回」…目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファンド・オブ・ファンズ」…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (含む日本)		
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
社債		アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、7,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

# 1 日本を含む世界のロボット関連企業の株式に投資します。

※株式…DR(預託証券)を含みます。

当ファンドにおける  
ロボット関連企業とは

ロボット・テクノロジーの開発や製造などにより、ビジネスを展開する企業を指します。

## 着目点



※上記はテーマの一例であり、上記以外のテーマにも投資する可能性があります。

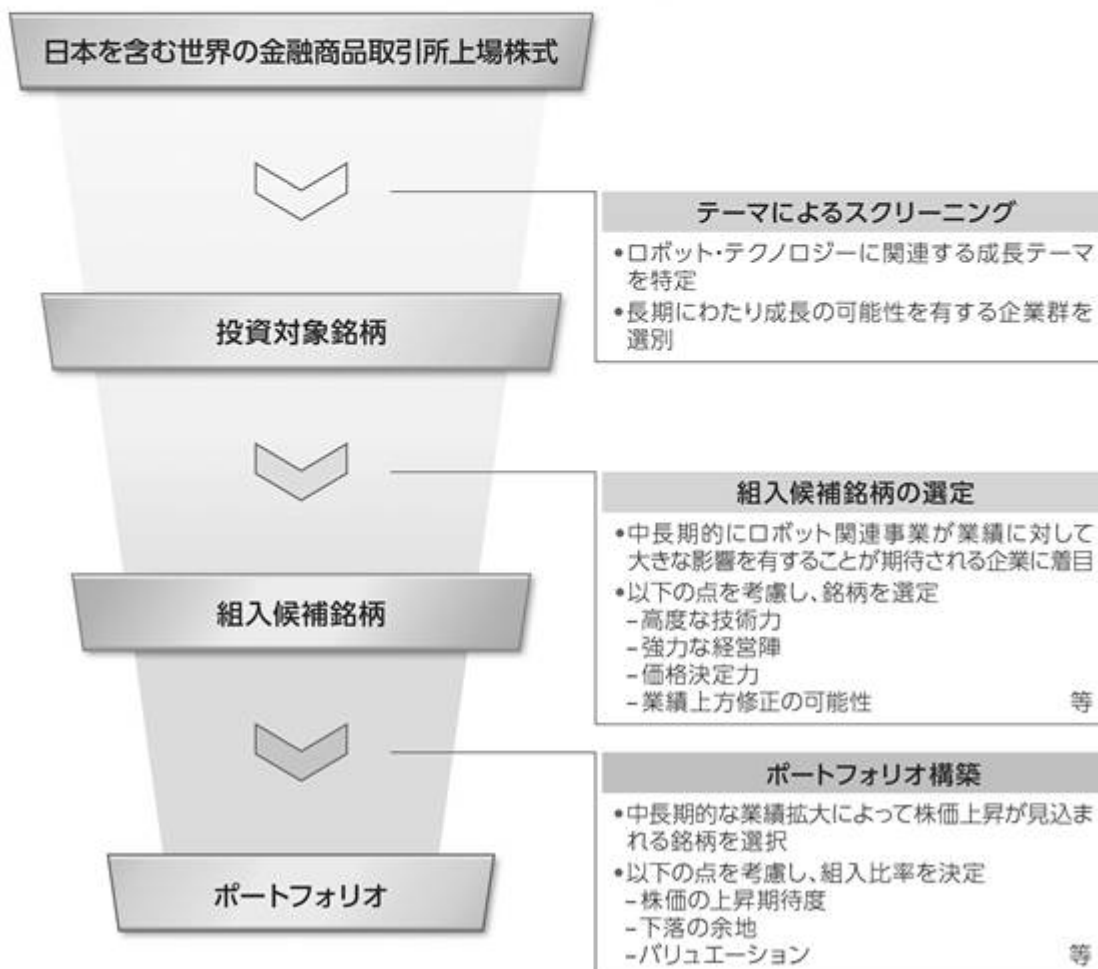
※上記の写真はイメージです。

## ② 株式の運用は、アクサ・インベストメント・マネージャーズが担当します。

### アクサ・インベストメント・マネージャーズについて

- ◆ 数多くのテーマ運用で豊富な実績を有するアクサ・インベストメント・マネージャーズは、世界最大級の保険・資産運用グループであるアクサ・グループの資産運用部門です。
- ◆ 1994年に設立され、運用資産総額は8,006億ユーロ（約98兆円）です。（2019年12月末現在）

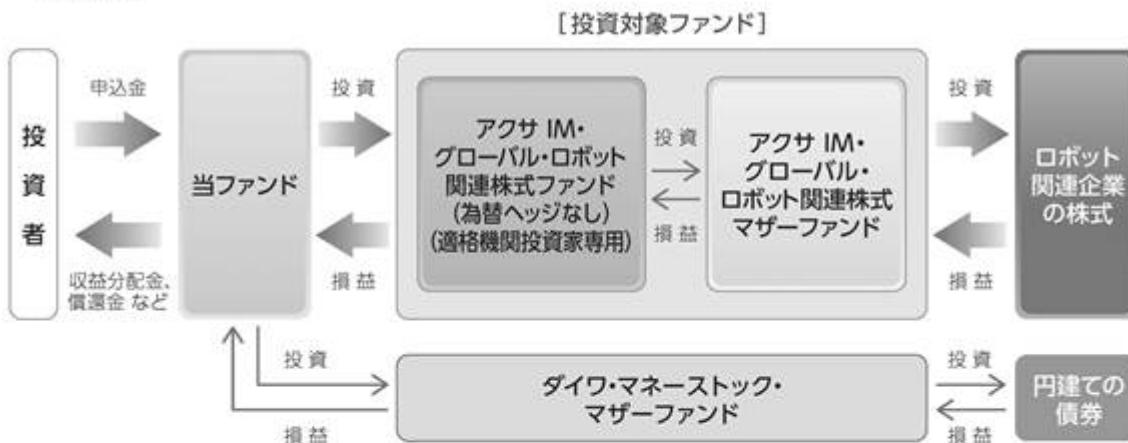
### 銘柄選定およびポートフォリオ構築のイメージ



※銘柄選定およびポートフォリオ構築のイメージについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、ロボット関連企業の株式に投資します。



### 投資対象ファンドについて

- ◆ アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) (以下「ロボット関連株式ファンド」といいます。)は、アクサ・インベストメント・マネージャーズ株式会社が設定・運用を行ないます。
- ◆ 株式の運用の指図に関する権限を、アクサ・インベストメント・マネージャーズ UK リミテッドに委託します。

※アクサ・インベストメント・マネージャーズ UK リミテッドは、アクサ・インベストメント・マネージャーズのロンドン拠点です。

※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

- ◆ 「ロボット関連株式ファンド」への投資割合を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ◆ 「ロボット関連株式ファンド」は、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを原則として行ないません。

- ◆ 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～2.の運用が行なわれないことがあります。

**③** 毎年3月13日および9月13日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### [分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

< 投資対象ファンドの概要 >

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

基本方針	<p>&lt;アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)&gt;(以下、「ベビーファンド」)</p> <p>アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド(以下、「マザーファンド」)の受益証券を通じて、信託財産の成長をめざして運用を行います。</p> <p>&lt;マザーファンド&gt;</p> <p>信託財産の成長をめざして運用を行いません。</p>
主要投資対象	<p>&lt;ベビーファンド&gt;</p> <p>マザーファンドの受益証券</p> <p>&lt;マザーファンド&gt;</p> <p>日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)および株式関連証券</p>

投資態度	<p>&lt;ベビーファンド&gt;</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として、マザーファンドの受益証券に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。</li> <li>2. マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に維持します。</li> <li>3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>4. 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</li> </ol> <p>&lt;マザーファンド&gt;</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 技術革新が進展することで、ロボットおよび自動システムならびにセンサーシステムが産業プロセス、交通、ヘルスケアおよびコンシューマー向けアプリケーションに、より一層統合されることをめざす分野に着目し、世界中の主としてロボット関連および自動システムに関する調査、開発、デザインおよび製作に従事する企業に投資することで、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。</li> <li>2. ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 <ol style="list-style-type: none"> <li>イ) 日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式から、ロボット・テクノロジーに関連する成長テーマを特定し、金融・経済情勢などを勘案することで長期にわたり成長の可能性を有する企業群を投資対象銘柄とします。</li> <li>ロ) 投資対象銘柄の中から、中長期的にロボット関連事業が業績に対して大きな影響を有することが期待される企業に着目し、高度な技術力、強力な経営陣、価格決定力および業績上方修正の可能性などを考慮することで、組入候補銘柄を選定します。</li> <li>ハ) 選定した組入候補銘柄から、アクサ・インベストメント・マネージャーズの企業調査機能などを活用し、中長期的な業績拡大によって株価上昇が見込まれる銘柄を選択します。また、株価の上昇期待度、下落の余地やバリュエーションなどを考慮して組入比率を決定し、ポートフォリオを構築します。</li> </ol> </li> <li>3. 株式および株式関連証券の組入比率は、原則として高位に維持します。</li> <li>4. 運用にあたっては、アクサ・インベストメント・マネージャーズUKリミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。</li> <li>5. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>6. 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</li> </ol>
ベンチマーク	なし



主な投資制限	<p>&lt;ベビーファンド&gt;</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>3. 同一企業が発行する株式の実質組入比率の合計は、純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 有価証券先物取引およびオプション取引、金利に係る先物取引およびオプション取引、通貨に係る先物取引およびオプション取引、スワップ取引等のデリバティブ取引は行いません。</li> <li>5. 有価証券の空売りは行いません。</li> <li>6. 信用取引は行いません。</li> <li>7. 資金の借入れは信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>8. 上記にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャーおよび債券等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> <li>9. 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券等を除く。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ol> <p>&lt;マザーファンド&gt;</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>3. 同一企業が発行する株式の組入比率の合計は、純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 有価証券先物取引およびオプション取引、金利に係る先物取引およびオプション取引、通貨に係る先物取引およびオプション取引、スワップ取引等のデリバティブ取引は行いません。</li> <li>5. 有価証券の空売りは行いません。</li> <li>6. 信用取引は行いません。</li> <li>7. 上記にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャーおよび債券等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> <li>8. 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ol>
決算日	毎年2月13日および8月13日（休業日の場合翌営業日）
信託期間	約10年（信託終了日：2025年9月11日）

収益分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益(繰越欠損補填後、評価損益を含む)等の金額とします。</p> <p>分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないこともあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <p>留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。</p>
運用管理費用 (信託報酬)等	<p>純資産総額に対し、年率0.5775%(税抜0.525%)を乗じて得た額とします。</p> <p>運用管理費用(信託報酬)の他に、信託事務の諸費用、監査報酬、およびその他諸費用がかかります。</p>
設定日	2015年12月8日
委託会社	アクサ・インベストメント・マネージャーズ株式会社
運用委託先	<p>&lt;マザーファンド&gt;</p> <p>アクサ・インベストメント・マネージャーズUKリミテッド</p>
受託会社	株式会社りそな銀行

## 2. ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
投資態度	<p>円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。</p> <p>円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
設定日	2010年3月5日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用 (信託報酬)	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

### (2) 【ファンドの沿革】

2015年12月7日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行</p> <p>信託財産の運用指図</p> <p>信託財産の計算</p> <p>運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3）
受託会社	株式会社 りそな銀行	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（*）に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分</p> <p>信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（*）	
	損益 投資	
投資対象	投資対象ファンドの受益証券 など	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

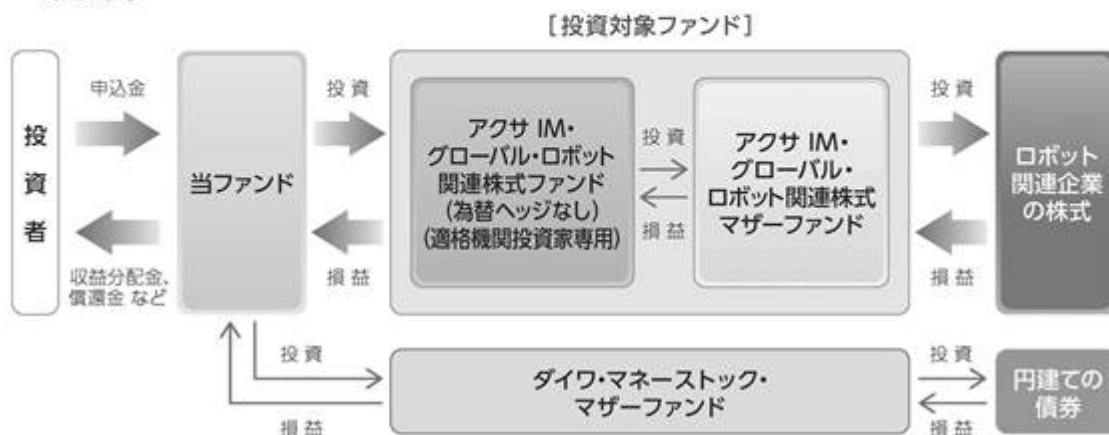
3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、ロボット関連企業の株式に投資します。



< 委託会社の概況 (2020年3月末日現在) >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

次の受益証券（振替受益権を含みます。）を主要投資対象とします。

1. アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）（以下「ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）」といいます。）の受益証券
2. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

- イ．主として、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）の受益証券を通じて、日本を含む世界のロボット関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ロ．当ファンドは、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ハ．ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### <投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）
選定の方針	主として、日本を含む世界のロボット関連企業の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざすファンドである。

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

### (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1．に掲げる親投資信託の受益証券、次の2．に掲げる証券投資信託の受益証券（振替受益権を含みます。）、ならびに次の3．から5．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1．ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
- 2．アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）の受益証券
- 3．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 4．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3．の証券の性質を有するもの
- 5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1．および前2．の受益証券を「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前 に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

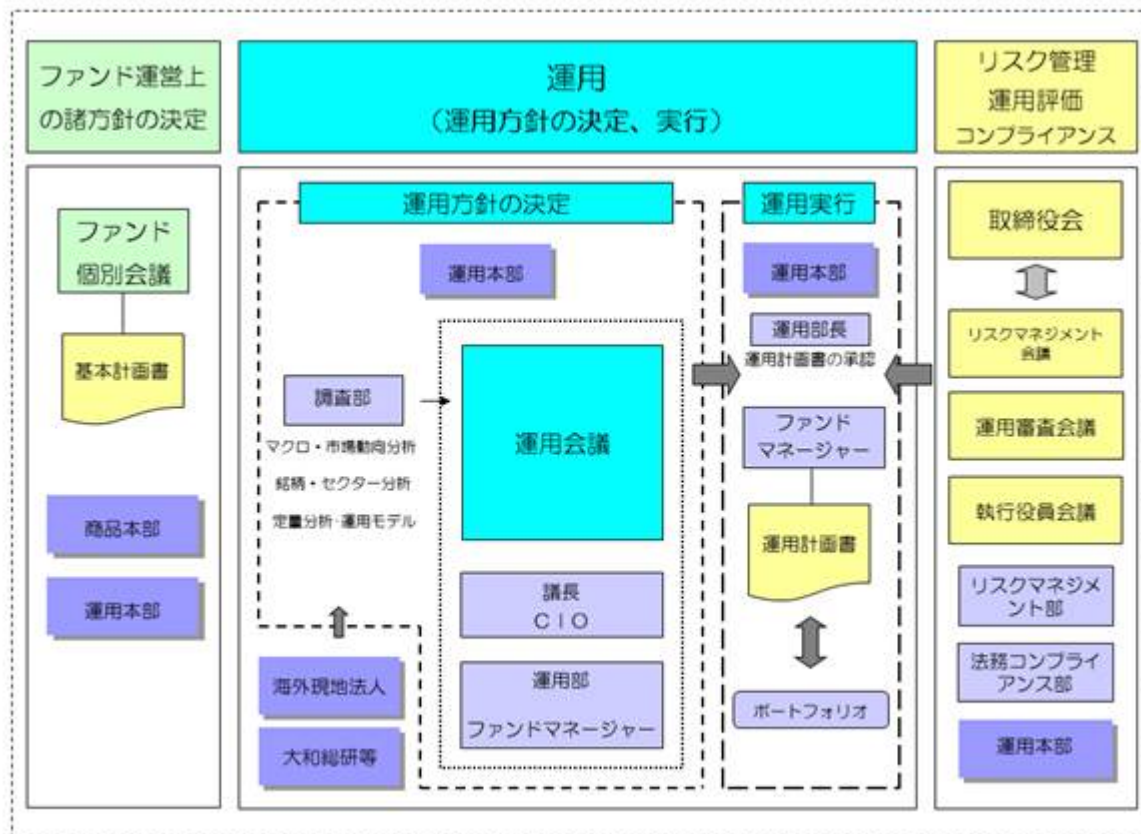
投資先ファンドの名称	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンドの受益証券を通じて、信託財産の成長をめざして運用を行います。
主要な投資対象	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンドの受益証券を通じて、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資します。
委託会社の名称	アクサ・インベストメント・マネージャーズ株式会社

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

#### 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。

#### 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO(Chief Investment Officer)(1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO(0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー(0~5名程度)

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長(各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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25~35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。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は2020年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。

原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。



留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとし、

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### < 参 考 > 投資対象ファンドについて

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

「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

2. ダイワ・マネースtock・マザーファンド

下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、

「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
償還条項	<p>信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。</p>

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

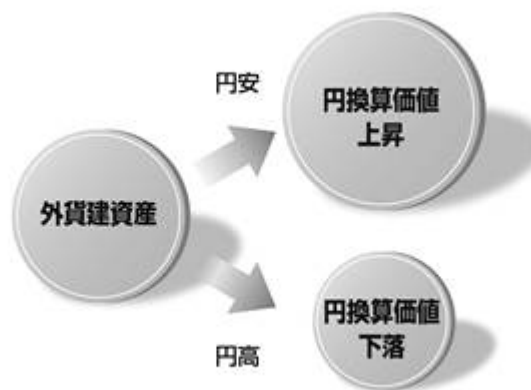
当ファンドは、特定の業種への投資比率が高くなるため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため、基準価額は為替レートの変動の影響を直接受けます。

#### ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが株式市場や為替市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

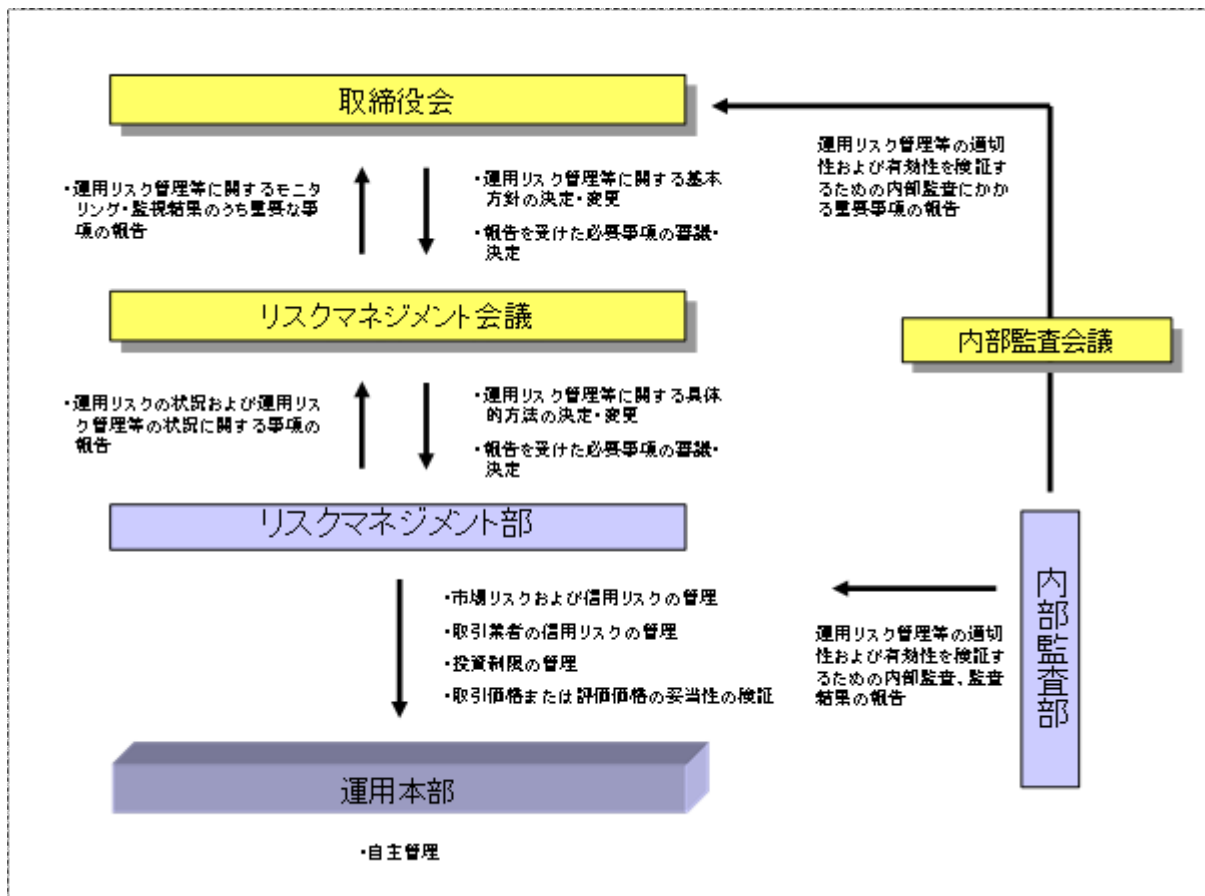
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



## 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」と

し、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

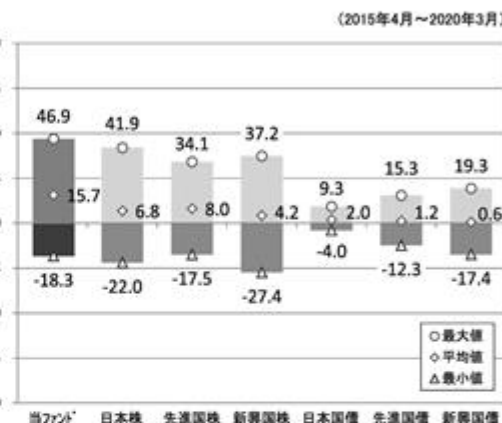
## 参考情報

◆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



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※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、野村證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證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】

### (1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.2375%（税抜1.125%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.75% （税抜）	年率0.025% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」の<投資対象ファンドの概要>をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率1.815%（税込）程度です。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

#### <投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

##### ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等(特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。)の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります(他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。)。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります(他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。)。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

#### 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%(所得税15%)の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### <注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。)が当該投資者の元本(個別元本)にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金(特別分配金)を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

#### <注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。



投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- ( ) 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、2020年3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。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（2020年3月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	192,799,425,541	99.26
内 日本	192,799,425,541	99.26
親投資信託受益証券	948,594	0.00
内 日本	948,594	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,428,575,526	0.74
純資産総額	194,228,949,661	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】（2020年3月31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	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	アクサIM・グローバル・ ロボット関連株式ファンド (為替ヘッジなし)	日本	投資信 託受益 証券	140,842,592,988	1.2114 170,628,107,073	1.3689 192,799,425,541	99.26
2	ダイワ・マネースtock・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	947,268	1.0014 948,594	1.0014 948,594	0.00

(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	99.26%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.26%

(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)
第1計算期間末 (2016年3月14日)	65,314,996,825	65,314,996,825	0.9162	0.9162
第2計算期間末 (2016年9月13日)	99,403,849,699	99,403,849,699	0.9333	0.9333
第3計算期間末 (2017年3月13日)	121,637,491,735	130,537,916,367	1.0933	1.1733
第4計算期間末 (2017年9月13日)	222,412,018,176	230,804,353,027	1.1926	1.2376
第5計算期間末 (2018年3月13日)	389,377,406,164	398,434,335,094	1.2898	1.3198
第6計算期間末 (2018年9月13日)	390,553,758,766	390,553,758,766	1.2761	1.2761
第7計算期間末 (2019年3月13日)	345,939,589,556	345,939,589,556	1.2294	1.2294
2019年3月末日	341,187,010,851	-	1.2381	-
4月末日	332,548,878,810	-	1.3481	-
5月末日	283,769,316,397	-	1.1787	-
6月末日	300,140,338,959	-	1.2598	-
7月末日	297,881,050,323	-	1.2810	-
8月末日	275,974,495,780	-	1.1944	-
第8計算期間末 (2019年9月13日)	294,492,731,210	294,492,731,210	1.2812	1.2812
9月末日	281,657,745,824	-	1.2424	-
10月末日	288,800,541,804	-	1.3021	-
11月末日	279,082,192,081	-	1.3854	-
12月末日	258,105,445,747	-	1.4327	-

2020年1月末日	240,019,890,370	-	1.4142	-
2月末日	213,377,314,420	-	1.2988	-
第9計算期間末 (2020年3月13日)	171,257,910,690	171,257,910,690	1.0399	1.0399
3月末日	194,228,949,661	-	1.1735	-

## 【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	0.0800
第4計算期間	0.0450
第5計算期間	0.0300
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	25.7
第4計算期間	13.2
第5計算期間	10.7
第6計算期間	1.1
第7計算期間	3.7
第8計算期間	4.2
第9計算期間	18.8

## (4) 【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	71,775,567,207	583,896,854
第2計算期間	50,362,863,348	15,150,018,696
第3計算期間	56,126,368,097	51,375,575,199
第4計算期間	126,564,066,053	51,323,043,931
第5計算期間	176,517,473,751	61,116,172,754
第6計算期間	55,249,792,895	51,099,567,426

第7計算期間	18,064,213,985	42,723,122,480
第8計算期間	10,484,854,112	62,011,008,625
第9計算期間	8,842,767,581	74,026,509,504

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

(参考) 投資信託証券

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

(1) 投資状況

(2020年3月末日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	202,299,506,334	99.58
内 日本	202,299,506,334	99.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	857,435,551	0.42
純資産総額	203,156,941,885	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2020年3月末日現在)

	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	数量 (株)	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 時価金額 (円)	利率 (%) 償還期 限 (年/ 月/日)	投資 比率
1	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド	日本・ 円  日本	親投資 信託受 益証券  -	177,814,455,774	1.4364  255,422,788,285	1.1377  202,299,506,334	-  -	99.58%

(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評価金額の比率です。

種類別および業種別投資比率

(2020年3月末日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	親投資信託受益証券	99.58
	小計		99.58
合計(対純資産総額比)			99.58

## 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。

## 参考情報 アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド

## 投資状況

(2020年3月末日現在)

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

## その他資産の投資状況

(2020年3月末日現在)

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	10,007,357	0.00
内 日本	10,007,357	0.00

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

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

## 投資資産

（2020年3月末日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

	銘柄名	通貨 地域	種類 業種	数量 (株)	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 時価金額 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/ 日)	投資 比率
1	キーエンス	日本・円 日本	株式 電気機器	243,000	30,313.88 7,366,273,700	34,830.00 8,463,690,000	- -	3.94%
2	INTUITIVE SURGICAL INC	アメリ カ・ドル アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	141,219	56,275.31 7,947,144,265	54,874.26 7,749,288,490	- -	3.61%
3	ALPHABET INC- CL C	アメリ カ・ドル アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	57,795	127,843.68 7,388,726,023	124,808.42 7,213,302,668	- -	3.36%
4	AMAZON.COM INC.	アメリ カ・ドル アメリカ	株式 小売	33,416	194,619.43 6,503,402,928	213,736.67 7,142,224,848	- -	3.33%

5	DEXCOM INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	207,706	16,581.76 3,444,131,097	30,254.73 6,284,091,0	- -	2.93%
6	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	188,022	29,601.75 5,565,782,118	31,012.19 5,830,975,266	- -	2.72%
7	AUTODESK INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	341,699	16,254.13 5,554,023,030	16,967.68 5,797,841,099	- -	2.70%
8	APPLE INC.	アメリカ・ドル アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	198,850	21,818.23 4,338,556,705	27,730.97 5,514,303,841	- -	2.57%
9	QUALCOMM INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	692,869	7,596.33 5,263,264,342	7,512.53 5,205,202,543	- -	2.43%
10	ANSYS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	201,284	22,783.76 4,586,007,709	25,589.19 5,150,696,110	- -	2.40%
11	PTC INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	781,964	7,056.14 5,517,650,375	6,450.35 5,043,944,693	- -	2.35%



12	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾・ドル  台湾	株式  半導体・ 半導体製 造装置	5,247,000	901.09  4,728,019,230	960.32  5,038,825,275	-  -	2.35%
13	CADENCE DESIGN SYS INC	アメリカ・ドル  アメリカ	株式  ソフト ウェア・ サービス	683,050	7,478.79  5,108,392,700	7,281.81  4,973,843,940	-  -	2.32%
14	TERADYNE INC	アメリカ・ドル  アメリカ	株式  半導体・ 半導体製 造装置	821,209	5,671.27  4,657,302,671	6,011.76  4,936,918,972	-  -	2.30%
15	TEAMVIEWER AG	ユーロ  ドイツ	株式  ソフト ウェア・ サービス	1,084,449	3,167.66  3,435,168,235	4,399.43  4,770,968,308	-  -	2.22%
16	NVIDIA CORP	アメリカ・ドル  アメリカ	株式  半導体・ 半導体製 造装置	161,357	18,034.10  2,909,929,210	28,904.15  4,663,888,496	-  -	2.17%
17	S M C	日本・円  日本	株式  機械	97,200	39,060.00  3,796,632,000	45,750.00  4,446,900,000	-  -	2.07%
18	SILICON LABORATORIES INC	アメリカ・ドル  アメリカ	株式  半導体・ 半導体製 造装置	479,171	11,161.22  5,348,137,162	9,252.72  4,433,638,257	-  -	2.07%
19	COGNEX CORP	アメリカ・ドル  アメリカ	株式  テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	862,095	4,680.77  4,035,275,568	4,947.41  4,265,138,975	-  -	1.99%
20	ダイフク	日本・円  日本	株式  機械	610,700	4,941.40  3,017,713,519	6,850.00  4,183,295,000	-  -	1.95%

21	TRIMBLE INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,175,615	4,008.97 4,713,014,457	3,376.99 3,970,045,859	- -	1.85%
22	TEXAS INSTRUMENTS INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	353,207	13,068.30 4,615,817,298	11,102.83 3,921,599,606	- -	1.83%
23	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 資本財	258,360	18,062.74 4,666,691,281	14,338.35 3,704,456,751	- -	1.73%
24	ILLUMINA INC	アメリカ・ドル アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	117,952	31,622.19 3,729,900,728	30,062.11 3,545,886,104	- -	1.65%
25	KONINKLIJKE PHILIPS NV	ユーロ オランダ	株式 ヘルスケア機器・サービス	765,077	4,961.04 3,795,582,188	4,387.48 3,356,763,861	- -	1.56%
26	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ・ドル アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	643,276	3,469.50 2,231,851,738	5,208.60 3,350,569,818	- -	1.56%
27	オムロン	日本・円 日本	株式 電気機器	589,400	5,050.00 2,976,470,000	5,630.00 3,318,322,000	- -	1.55%
28	IPG PHOTONICS CORP	アメリカ・ドル アメリカ	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	272,631	13,529.85 3,688,658,024	11,884.23 3,240,011,144	- -	1.51%

29	安川電機	日本・円	株式	1,074,500	3,425.58	2,976.00	-	1.49%
		日本	電気機器		3,680,793,947	3,197,712,000	-	
30	ASPEN TECHNOLOGY INC	アメリカ・ドル	株式	297,224	14,463.35	10,659.89	-	1.48%
		アメリカ	ソフトウェア・サービス		4,298,855,371	3,168,377,671	-	

(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評価金額の比率です。

### 種類別および業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	機械	5.06
		電気機器	9.62
		卸売業	1.32
	小計		16.00
	外国	資本財	7.16
		自動車・自動車部品	0.81
		小売	4.70
		ヘルスケア機器・サービス	14.45
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.80
		ソフトウェア・サービス	13.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10.08
		半導体・半導体製造装置	21.60
	メディア・娯楽	3.36	
小計		80.43	
合 計(対純資産総額比)			96.43

### 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

種類	地域	資産名	買 建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	アメリカ・ドル買/円 売 2020年04月	買建	91,970	10,000,000	10,007,357	0.00%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(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。

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。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

(1) 投資状況 (2020年3月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	76,809,622,184	100.00
純資産総額	76,809,622,184	100.00

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

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

(2) 投資資産 (2020年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

該当事項はありません。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

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。

(参考情報) 運用実績

## ● ロボット・テクノロジー関連株ファンド ―ロボテック―

2020年3月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,735円
純資産総額	1,942億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-9.6%
3カ月間	-18.1%
6カ月間	-5.5%
1年間	-5.2%
3年間	13.7%
5年間	-
設定来	33.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において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: 1,550円		
	第1期 16年3月	第2期 16年9月	第3期 17年3月	第4期 17年9月	第5期 18年3月	第6期 18年9月	第7期 19年3月	第8期 19年9月	第9期 20年3月			
分配金	0円	0円	800円	450円	300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。

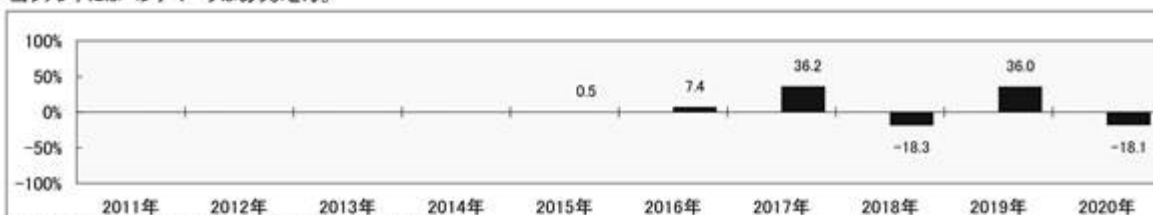
## 主要な資産の状況

※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
アクサ・インベストメント・マネージャーズ	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)	99.3%
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		99.3%

## 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。  
・2015年は設定日(12月7日)から年末、2020年は3月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行いません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行いません。

### 2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約請求の受け付けを中止することができます。

一部解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）の受益証券：計算日の基準価額で評価します。
- ・ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
  3. 価格情報会社の提供する価額

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
  - 電話番号（コールセンター） 0120-106212
  - （営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

2015年12月7日から2025年9月12日までとします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4) 【計算期間】



毎年3月14日から9月13日まで、および9月14日から翌年3月13日までとします。ただし、第1計算期間は、2015年12月7日から2016年3月13日までとし、最終計算期間は、2025年3月14日から2025年9月12日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

#### (5) 【その他】

##### 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とするアクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
4. 前3.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本 1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

## 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

## 4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

### 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分にに応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

### 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。



### 第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)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、第9期計算期間(2019年9月14日から2020年3月13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】

ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック -

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2019年9月13日現在	第9期 2020年3月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,928,442,535	4,773,851,811
投資信託受益証券	293,310,552,359	168,628,107,073
親投資信託受益証券	948,783	948,594
未収入金	200,000,000	-
流動資産合計	297,439,943,677	173,402,907,478
資産合計	297,439,943,677	173,402,907,478
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,072,656,136	521,774,422
未払受託者報酬	41,632,620	36,046,837
未払委託者報酬	1,831,837,180	1,586,063,279
その他未払費用	1,086,531	1,112,250
流動負債合計	2,947,212,467	2,144,996,788
負債合計	2,947,212,467	2,144,996,788
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 229,862,793,483	1 164,679,051,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,629,937,727	6,578,859,130
（分配準備積立金）	16,452,352,425	11,231,950,094
元本等合計	294,492,731,210	171,257,910,690
純資産合計	294,492,731,210	171,257,910,690
負債純資産合計	297,439,943,677	173,402,907,478

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2019年3月14日 至 2019年9月13日	自	2019年9月14日 至 2020年3月13日
<b>営業収益</b>				
受取利息		311		11,110
有価証券売買等損益		17,595,021,704		31,482,445,475
営業収益合計		17,595,022,015		31,482,434,365
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,195,556		898,444
受託者報酬		41,632,620		36,046,837
委託者報酬		1,831,837,180		1,586,063,279
その他費用		1,470,982		1,144,557
営業費用合計		1,876,136,338		1,624,153,117
営業利益又は営業損失( )		15,718,885,677		33,106,587,482
経常利益又は経常損失( )		15,718,885,677		33,106,587,482
当期純利益又は当期純損失( )		15,718,885,677		33,106,587,482
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		3,928,473,823		7,140,621,064
期首剰余金又は期首欠損金( )		64,550,641,560		64,629,937,727
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,540,389,245		3,063,589,289
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,540,389,245		3,063,589,289
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,251,504,932		20,867,459,340
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,251,504,932		20,867,459,340
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		64,629,937,727		6,578,859,130

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第9期	
	自 2019年9月14日	至 2020年3月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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、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。</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)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
1. 1 期首元本額	281,388,947,996円	229,862,793,483円
期中追加設定元本額	10,484,854,112円	8,842,767,581円
期中一部解約元本額	62,011,008,625円	74,026,509,504円
2. 計算期間末日における受益権の総数	229,862,793,483口	164,679,051,560口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	自 2019年3月14日 至 2019年9月13日	自 2019年9月14日 至 2020年3月13日



<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>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(0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(871,701,613円)、投資信託約款に規定される収益調整金(48,178,690,981円)及び分配準備積立金(15,580,650,812円)より分配対象額は64,631,043,406円(1万口当たり2,811.72円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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(0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(22,948,980,661円)及び分配準備積立金(11,231,950,094円)より分配対象額は34,180,930,755円(1万口当たり2,075.61円)であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	--	--

## (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	第9期 自 2019年9月14日 至 2020年3月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」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、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券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	第9期
	2020年3月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(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	第8期	第9期
	2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	13,713,205,922	38,366,966,378
親投資信託受益証券	379	189
合計	13,713,205,543	38,366,966,567

## (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

第8期	第9期
2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第9期
自 2019年9月14日
至 2020年3月13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なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2019年9月13日現在	第9期 2020年3月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2812円 (12,812円)	1.0399円 (10,399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
投資信託受益証券	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	139,212,504,808	168,628,107,073	
投資信託受益証券 合計			168,628,107,073	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	947,268	948,594	
親投資信託受益証券 合計			948,594	
合計			168,629,055,667	

投資信託受益証券及び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、「アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」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「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、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計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### ファンドの経理状況

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）及び同規則第2条の2の規定による「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）並びに我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、第7期計算期間（2019年2月14日から2019年8月13日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。  
その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

### 財務諸表

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

#### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	第6期 (2019年2月13日現在)	第7期 (2019年8月13日現在)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン	93,754,000	299,874,705
親投資信託受益証券	362,643,636,001	280,871,828,299
未収入金	600,000,000	800,000,000
流動資産合計	363,337,390,001	281,971,703,004
資産合計	363,337,390,001	281,971,703,004
負債の部		
流動負債		
未払解約金	599,999,999	-
未払受託者報酬	40,123,378	35,656,053
未払委託者報酬	1,013,116,603	900,316,544
その他未払費用	600,448	599,514
流動負債合計	1,653,840,428	936,572,111
負債合計	1,653,840,428	936,572,111
純資産の部		
元本等		
元本	262,272,544,421	208,549,294,874
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	99,411,005,152	72,485,836,019
(分配準備積立金)	61,092,172,037	49,337,731,368
元本等合計	361,683,549,573	281,035,130,893
純資産合計	361,683,549,573	281,035,130,893
負債純資産合計	363,337,390,001	281,971,703,004

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

	第6期 (自 2018年8月14日 至 2019年2月13日)	第7期 (自 2019年2月14日 至 2019年8月13日)
営業収益		
有価証券売買等損益	14,995,391,433	454,192,298
営業収益合計	14,995,391,433	454,192,298
営業費用		
支払利息	46,114	24,375
受託者報酬	40,123,378	35,656,053
委託者報酬	1,013,116,603	900,316,544
その他費用	730,115	614,094
営業費用合計	1,054,016,210	936,611,066
営業利益又は営業損失( )	16,049,407,643	482,418,768
経常利益又は経常損失( )	16,049,407,643	482,418,768

当期純利益又は当期純損失( )	16,049,407,643	482,418,768
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	186,151,002	6,080,366,881
期首剰余金又は期首欠損金( )	125,495,621,019	99,411,005,152
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,487,937,594	41,743,649
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,487,937,594	41,743,649
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,709,296,820	20,404,127,133
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,709,296,820	20,404,127,133
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	99,411,005,152	72,485,836,019

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法による時価で評価しております。 なお、時価は、親投資信託受益証券の基準価額を用いております。
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		第6期 (2019年2月13日現在)	第7期 (2019年8月13日現在)
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	285,277,336,140円	262,272,544,421円
	期中追加設定元本額	3,612,062,413円	108,256,352円
	期中一部解約元本額	26,616,854,132円	53,831,505,899円
2.	受益権の総数	262,272,544,421口	208,549,294,874口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 (自2018年8月14日 至2019年2月13日)		第7期 (自2019年2月14日 至2019年8月13日)	
1. 分配金の計算過程		1. 分配金の計算過程	
費用控除後の配当等収益額	586,074,859円	費用控除後の配当等収益額	784,738,906円

費用控除後・繰越欠損金 補填後の有価証券売買等 損益額	- 円	費用控除後・繰越欠損 金補填後の有価証券売 買等損益額	- 円
収益調整金額	52,061,237,593円	収益調整金額	41,422,386,881円
分配準備積立金額	60,506,097,178円	分配準備積立金額	48,552,992,462円
当ファンドの分配対象収 益額	113,153,409,630円	当ファンドの分配対象 収益額	90,760,118,249円
当ファンドの期末残存口 数	262,272,544,421口	当ファンドの期末残存 口数	208,549,294,874口
1万口当たり収益分配対象 額	4,314.34円	1万口当たり収益分配 対象額	4,351.97円
1万口当たり分配金額	- 円	1万口当たり分配金額	- 円
収益分配金金額	- 円	収益分配金金額	- 円
2. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一 部を委託するために要する費用		2. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は 一部を委託するために要する費用	
委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額より、運用権限委託契約に定められた報酬額を支払っております。		同左	

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第6期 (自 2018年 8月14日 至 2019年 2月13日)	第7期 (自 2019年2月14日 至 2019年8月13日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を主要投資対象としております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク&コントロール部門を設置し、全社的なリスク管理活動およびガイドラインのモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
-------------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

	第6期 2019年2月13日現在	第7期 2019年8月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額ははありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            上記以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位:円)



種類	第6期 (2019年2月13日現在)	第7期 (2019年8月13日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評 価差額	当計算期間の損益に含まれた評 価差額
親投資信託受益証券	14,855,544,114	5,715,634,745
合計	14,855,544,114	5,715,634,745

(デリバティブ取引等に関する注記)

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)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第6期 (2019年2月13日現在)	第7期 (2019年8月13日現在)
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3790円 (13,790円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

#### (4) 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	アクサ IM・グローバル・ロ ボット関連株式マザーファンド	251,790,074,675	280,871,828,299	
親投資信託受益証券	合計	251,790,074,675	280,871,828,299	
合計		251,790,074,675	280,871,828,299	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## &lt;参考情報&gt;

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

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

流動負債合計	1,563,770,368	1,327,257,941
負債合計	1,563,770,368	1,327,257,941
純資産の部		
元本等		
元本	338,565,889,925	267,501,155,254
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,785,476,040	30,895,995,208
元本等合計	385,351,365,965	298,397,150,462
純資産合計	385,351,365,965	298,397,150,462
負債純資産合計	386,915,136,333	299,724,408,403

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>組入有価証券（株式）については移動平均法に基づき、以下のとおり、原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合は、当該金融商品取引所等における直近の最終相場もしくは当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合、又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--------------------	---

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	368,413,075,965円	338,565,889,925円
	期中追加設定元本額	2,302,420,788円	- 円
	期中一部解約元本額	32,149,606,828円	71,064,734,671円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし） （適格機関投資家専用）	318,611,523,459円	251,790,074,675円
	アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジあり） （適格機関投資家専用）	19,954,366,466円	15,711,080,579円

	計	338,565,889,925円	267,501,155,254円
2.	受益権の総数	338,565,889,925口	267,501,155,254口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2018年8月14日 至 2019年2月13日	自 2019年2月14日 至 2019年8月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当該親投資信託は、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当該親投資信託が保有する主な金融資産は株式であり、売買目的で保有しております。 デリバティブ取引には、通貨関連では為替予約取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。 投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	当該親投資信託に投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年2月13日現在	2019年8月13日現在
--	--------------	--------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券          売買目的有価証券          （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引          （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品          上記以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券          同左</p> <p>(2) デリバティブ取引          該当はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品          同左</p>
3. 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よった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等はいくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<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よった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(単位：円)

種類	2019年2月13日 現在				2019年8月13日 現在			
	契約額等	うち 1年 超	時価	評価損益	契約額等		時価	評価 損 益
						うち 1年 超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-
合計	1,800,000,000	-	1,800,054,289	54,289	-	-	-	-

(注) 1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報 )

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

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

### (3) 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	ナブテスコ	1,170,400	2,941.000	3,442,146,400	
	S M C	147,500	39,060.000	5,761,350,000	
	ダイフク	772,800	4,800.000	3,709,440,000	
	安川電機	1,276,900	3,305.000	4,220,154,500	
	日本電産	368,200	13,705.000	5,046,181,000	
	オムロン	873,400	5,050.000	4,410,670,000	
	キーエンス	166,500	60,340.000	10,046,610,000	
	ファナック	359,000	17,825.000	6,399,175,000	
	ミスミグループ本社	1,765,900	2,323.000	4,102,185,700	
日本円 小計		6,900,600		47,137,912,600	
アメリカ・ドル	NXP SEMICONDUCTORS NV	368,151	98.250	36,170,835.75	
	WRIGHT MEDICAL GROUP NV	1,518,396	20.770	31,537,084.92	



ABIOMED INC	75,637	191.720	14,501,125.64	
ACCELERATE DIAGNOSTICS INC	940,253	17.260	16,228,766.78	
ADVANCED MICRO DEVICES	832,310	32.430	26,991,813.30	
APTIV PLC	412,126	82.560	34,025,122.56	
TE CONNECTIVITY LTD	523,270	88.170	46,136,715.90	
ALPHABET INC-CL C	87,876	1,174.710	103,228,815.96	
AMAZON.COM INC.	48,398	1,784.920	86,386,558.16	
ANALOG DEVICES	278,610	108.960	30,357,345.60	
ANSYS INC	273,613	207.040	56,648,835.52	
APPLE INC.	299,279	200.480	59,999,453.92	
ASPEN TECHNOLOGY INC	312,683	136.300	42,618,692.90	
AUTODESK INC	422,418	148.870	62,885,367.66	
BECTON DICKINSON & CO	164,601	249.160	41,011,985.16	
BLACKBERRY LTD	3,021,655	6.840	20,668,120.20	
CADENCE DESIGN SYS INC	998,939	68.720	68,647,088.08	
CISCO SYSTEMS	1,050,997	51.540	54,168,385.38	
COGNEX CORP	1,247,875	43.010	53,671,103.75	
DEXCOM INC	388,719	151.930	59,058,077.67	
GLOBUS MEDICAL INC-A	521,074	48.670	25,360,671.58	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	334,454	164.960	55,171,531.84	
IPG PHOTONICS CORP	271,580	118.620	32,214,819.60	
ILLUMINA INC	158,991	290.340	46,161,446.94	
INTUITIVE SURGICAL INC	170,973	509.880	87,175,713.24	

	LUMENTUM HOLDINGS INC	665,342	57.570	38,303,738.94	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	521,228	87.300	45,503,204.40	
	NOVANTA INC	381,556	71.090	27,124,816.04	
	NVIDIA CORP	194,556	151.450	29,465,506.20	
	NUVASIVE INC	454,105	65.360	29,680,302.80	
	PTC INC	1,087,745	64.650	70,322,714.25	
	PARKER HANNIFIN CORP	166,270	161.500	26,852,605.00	
	QUALCOMM INC	1,186,217	69.800	82,797,946.60	
	SILICON LABORATORIES INC	556,886	103.830	57,821,473.38	
	TERADYNE INC	1,511,537	52.250	78,977,808.25	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	532,848	120.080	63,984,387.84	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	285,313	272.000	77,605,136.00	
	TRIMBLE INC	1,611,036	37.210	59,946,649.56	
	XILINX INC	351,912	103.180	36,310,280.16	
	AMBARELLA INC	639,103	44.580	28,491,211.74	
アメリカ・ドル 小計		24,868,532		1,944,213,259.170 (204,978,403,914)	
イギリス・ポンド	OCADO GROUP PLC	2,204,410	11.925	26,287,589.250	
イギリス・ポンド 小計		2,204,410		26,287,589.250 (3,347,198,739)	
ユーロ	CONTINENTAL AG	177,849	110.980	19,737,682.020	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	450,689	73.060	32,927,338.340	
	DUERR AG	838,245	22.830	19,137,133.350	
	SIEMENS AG	601,048	88.620	53,264,873.760	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,710,735	16.060	43,534,404.100	

	KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,267,018	41.455	52,524,231.190	
	KION GROUP AG	791,388	42.790	33,863,492.520	
	MAREL HF	4,100,504	4.210	17,263,121.840	
ユーロ	小計	10,937,476		272,252,277.120 (32,172,051,587)	
台湾・ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,765,000	251.000	1,949,015,000.000	
台湾・ドル	小計	7,765,000		1,949,015,000.000 (6,548,690,400)	
合計		52,676,018		294,184,257,240 (247,046,344,640)	

## 有価証券明細表注記

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,298,074,038	86,311,084,265
流動資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265
資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,000,000,000	1,640,000,000
その他未払費用	61,004	-
流動負債合計	8,000,061,004	1,640,000,000
負債合計	8,000,061,004	1,640,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 95,143,024,361	84,552,982,137
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	154,988,673	118,102,128
元本等合計	95,298,013,034	84,671,084,265
純資産合計	95,298,013,034	84,671,084,265
負債純資産合計	103,298,074,038	86,311,084,265

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

自 2019年9月14日
至 2020年3月13日
該当事項はありません。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
1. 1 期首	2019年3月14日	2019年9月14日
期首元本額	61,033,452,384円	95,143,024,361円
期中追加設定元本額	112,979,654,634円	51,004,873,930円
期中一部解約元本額	78,870,082,657円	61,594,916,154円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ米国バンクローン・ ファンド(為替ヘッジあり) 2014-11	9,962円	- 円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド - ロボテック -	947,268円	947,268円
ダイワ/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
US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
US短期高利回り社債ファン ド(為替ヘッジあり/年1回 決算型)	1,994円	- 円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド - ロボテック - (為替ヘッジあり)	39,849円	39,849円
ロボット・テクノロジー関連 株ファンド(年1回決算型) - ロボテック(年1回) - (為替ヘッジあり)	3,985円	3,985円

iFreeレバレッジ S&P500	995,814円	350,506,500円
iFreeレバレッジ NASDAQ100	29,943,109円	1,318,120,693円
米国4資産リスク分散ファン ド(年2回決算型)	- 円	695,894円
ダイワ上場投信 - 日経平均レ バレッジ・インデックス	4,911,565,673円	3,576,746,324円
ダイワ上場投信 - 日経平均ダ ブルインバース・インデック ス	4,536,789,944円	6,283,864,801円
ダイワ上場投信 - TOPIXレバ レッジ(2倍)指数	875,293,071円	695,513,811円
ダイワ上場投信 - TOPIXダブ ルインバース(-2倍)指数	1,076,577,900円	1,715,662,215円
ダイワ上場投信 - 日経平均イ ンバース・インデックス	46,620,451,844円	18,661,491,538円
ダイワ上場投信 - TOPIXイン バース(-1倍)指数	9,472,774,219円	8,174,312,515円
ダイワ上場投信 - J P X日経 400レバレッジ・インデック ス	303,574,325円	223,670,219円
ダイワ上場投信 - J P X日経 400インバース・インデック ス	811,328,174円	1,210,749,016円
ダイワ上場投信 - J P X日経 400ダブルインバース・イン デックス	511,559,859円	266,923,314円
ダイワ米国投資法人債ファン ド(為替ヘッジあり)2016- 07	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド(部分為替ヘッジあり) 2016-07	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド(為替ヘッジあり)2017- 06	997円	997円
ダイワ米国投資法人債ファン ド(部分為替ヘッジあり) 2017-06	997円	- 円
ダイワ米国投資法人債ファン ド(為替ヘッジあり)2016- 10	997円	997円

ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり) 2016-10	997円	- 円
先進国トータルリターン戦略 ファンド(リスク抑制型/適 格機関投資家専用)	4,492,163,684円	6,988,339,549円
ダイワ日本株式ベア・ファン ド(適格機関投資家専用)	6,922,448,226円	20,672,106,377円
低リスク型アロケーション ファンド(金利トレンド判断 付き/適格機関投資家専用)	179,433,743円	179,433,743円
ダイワ日本国債15-20年ラ ダー型ファンド・マネーポー トフォリオ - SLトレード - 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) -	186,025,234円	108,270,087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	5,020,480円	- 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	169,844,029円	91,246,524円
ダイワ・アセアン内需関連株 ファンド・マネー・ポート フォリオ	10,164,639円	8,372,185円
低リスク型アロケーション ファンド(適格機関投資家専 用)	13,958,125,625円	13,958,125,625円
通貨選択型ダイワ/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 為替ヘッジあり	49,806円	- 円
<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リート 為替ヘッジなし	49,806円	- 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(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(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(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)	100,588円	100,588円
- ロボテック(年1回) -		
ダイワ先進国リート 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 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 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 通貨セレクトコース (毎月分配型)	99,771円	99,771円
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(為替ヘッジあり)	1,091,429円	1,091,429円
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(為替ヘッジなし)	315,004円	315,004円
ダイワ/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 (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 (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 (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 (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 (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース(毎月分配型)	1,993,820円	1,993,820円

通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 日本 円・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 豪ド ル・コース	200,861円	200,861円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 ブラジ ル・リアル・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 米ド ル・コース	1,999,177円	1,999,177円
通貨選択型ダイワ米国厳選株 ファンド - イーグルアイ - 予想分配金提示型 通貨セ レクト・コース	505,900円	505,900円
計	95,143,024,361円	84,552,982,137円
2. 期末日における受益権の総数	95,143,024,361口	84,552,982,137口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年9月14日 至 2020年3月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」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、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。 これらの金融商品に係るリスクは、信用リスクであります。
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	2020年3月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2019年9月13日現在	2020年3月13日現在
1口当たり純資産額	1.0016円	1.0014円
(1万口当たり純資産額)	(10,016円)	(10,014円)

## 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

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2020年3月31日

資産総額	194,556,005,943円
負債総額	327,056,282円
純資産総額（ - ）	194,228,949,661円
発行済数量	165,510,145,770口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1735円

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

## 純資産額計算書

(2020年3月末日現在)

資産総額	203,318,372,502円
負債総額	161,430,617円
純資産総額（ - ）	203,156,941,885円
発行済数量	148,408,862,588口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3689円

参考情報 アクサ IM・グローバル・ロボット関連株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年3月末日現在)

資産総額	215,578,686,255円
負債総額	1,011,371,442円
純資産総額（ - ）	214,567,314,813円
発行済数量	188,591,276,709口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1377円

(参考) ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年3月31日

資産総額	76,889,622,184円
------	-----------------

負債総額	80,000,000円
純資産総額( - )	76,809,622,184円
発行済数量	76,704,758,675口
1単位当たり純資産額( / )	1.0014円

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行  
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者(とします。)に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。



## 第二部 【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】

##### a. 資本金の額

2020年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### 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。

##### ニ. 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。

2020年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	54	87,678
追加型株式投資信託	694	14,373,314
株式投資信託 合計	748	14,460,993
単位型公社債投資信託	27	100,159
追加型公社債投資信託	14	1,421,970
公社債投資信託 合計	41	1,522,128
総合計	789	15,983,121

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	利益剰余金	
				剰余金 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) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

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

(未適用の会計基準等)

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

#### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

#### (2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

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

(損益計算書)

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

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

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

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

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、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(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

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

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、記載していません。

## 2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

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

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

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。



当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	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)
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	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)
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

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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

## 前事業年度（2018年3月31日）

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

## 当事業年度（2019年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	---------	-------	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	211
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2019年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	6,021
未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474
流動負債合計	11,243
固定負債	
退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7
固定負債合計	2,619
負債合計	13,862
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,968
利益剰余金合計	7,343
株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

## 当中間会計期間

(自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868



中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

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

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### （2）その他有価証券

###### 時価のあるもの

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

###### 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

### 2 消費税等の取扱い

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

### 3 保証債務

当中間会計期間（2019年9月30日現在）

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

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

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

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

#### 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(注1)金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1)現金・預金及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1)未払金及び(2)未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	66	55	11
（2）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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。）。

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

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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



## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 株式会社りそな銀行

資本金の額 279,928百万円(2019年3月末日現在)

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2019年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	
株式会社SBI証券	48,323	
FFG証券株式会社	3,000	
岡三証券株式会社	5,000	
岡三オンライン証券株式会社	2,500	
岡三にいがた証券株式会社	852	
auカブコム証券株式会社	7,196	
ごうぎん証券株式会社	3,000	
寿証券株式会社	305	
GMOクリック証券株式会社	4,346	
七十七証券株式会社	3,000	
島大証券株式会社	100	
十六TT証券株式会社	(1)3,000	
荘内証券株式会社	100	
立花証券株式会社	6,695	
東海東京証券株式会社	6,000	
とちぎんTT証券株式会社	301	
中銀証券株式会社	2,000	
内藤証券株式会社	3,002	
南都まほろば証券株式会社	3,000	
西日本シティTT証券株式会社	3,000	
西村証券株式会社	500	
北洋証券株式会社	3,000	
野村証券株式会社	10,000	
ほくほくTT証券株式会社	1,250	

松阪証券株式会社	100	
マネックス証券株式会社	12,200	
三田証券株式会社	500	
水戸証券株式会社	12,272	
豊証券株式会社	2,540	
楽天証券株式会社	7,495	
リテラ・クリア証券株式会社	3,794	
株式会社あおぞら銀行	100,000	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社阿波銀行	23,452	
株式会社イオン銀行	51,250	
株式会社愛媛銀行	21,363	
株式会社沖縄海邦銀行	4,537	
株式会社関西みらい銀行	( 2 ) 38,900	
岐阜信用金庫	21,173	(注1)
株式会社京都銀行	42,103	(注2)
京都信用金庫	12,240	(注1)
株式会社熊本銀行	33,847	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759	
株式会社高知銀行	19,544	
株式会社埼玉りそな銀行	70,000	
株式会社佐賀銀行	16,062	
株式会社山陰合同銀行	20,705	
株式会社静岡中央銀行	2,000	
株式会社清水銀行	10,816	
株式会社十八銀行	24,404	
株式会社十六銀行	36,839	
信金中央金庫	690,998	(注3)
株式会社親和銀行	36,878	(注2)
全国信用協同組合連合会	67,275	(注4)
株式会社大光銀行	10,000	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社大東銀行	14,743	
株式会社但馬銀行	5,481	
株式会社筑邦銀行	8,000	
株式会社千葉興業銀行	62,120	
株式会社中京銀行	31,844	
株式会社筑波銀行	48,868	
株式会社東和銀行	38,653	
株式会社栃木銀行	27,408	
株式会社長野銀行	13,017	

株式会社百十四銀行	37,322	
広島信用金庫	3,634	(注1)
株式会社福岡銀行	82,329	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社福島銀行	18,127	
株式会社豊和銀行	12,495	
株式会社北洋銀行	121,101	
株式会社北陸銀行	140,409	
みずほ信託銀行株式会社	247,369	(注5)
株式会社宮崎銀行	14,697	銀行法に基づき
株式会社山形銀行	12,008	銀行業を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928	(注5)

( 1 ) 資本金の額は、2019年6月3日現在のものです。

( 2 ) 資本金の額は、2019年4月1日現在のものです。

(注1) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注3) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注4) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注5) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

## 3 【資本関係】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しております。

委託会社は、西村証券株式会社の株式を50,000株所有しております。

委託会社は、リテラ・クリア証券株式会社の株式を615,736株所有しております。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

### 第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2019年12月6日	有価証券届出書、有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年4月17日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック - の2019年9月14日から2020年3月13日までの計算期間の財務諸表、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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック - の2020年3月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。