

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年10月3日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて、5,000億円を上限とし、合計で1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

- DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)
- DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)
- DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

(注)以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとします。

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託(契約型)の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、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。

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

各ファンドについて、5,000億円を上限とし、合計で1兆5,000億円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

各ファンドについて、1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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/>

### (5) 【申込手数料】

取得申込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。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

- ・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、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

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。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

2019年10月4日から2020年4月3日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。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/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

受益権の取得申込者は、販売会社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。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（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。

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．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。）を締結するものとします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

取得申込金額に利息は付きません。

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な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。

1. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）
2. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）
3. DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）

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）	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	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
- ・「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数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

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1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
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行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〈各ファンド共通〉

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〈各ファンド共通〉

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

(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。

ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

ファンドの名称	略称
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	安定コース
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	6分散コース
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	成長コース

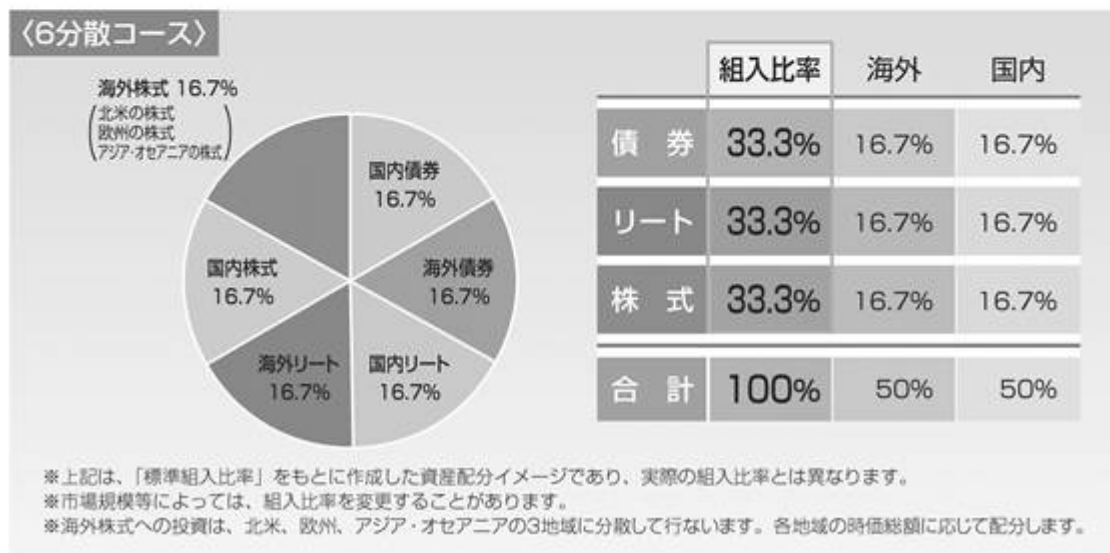
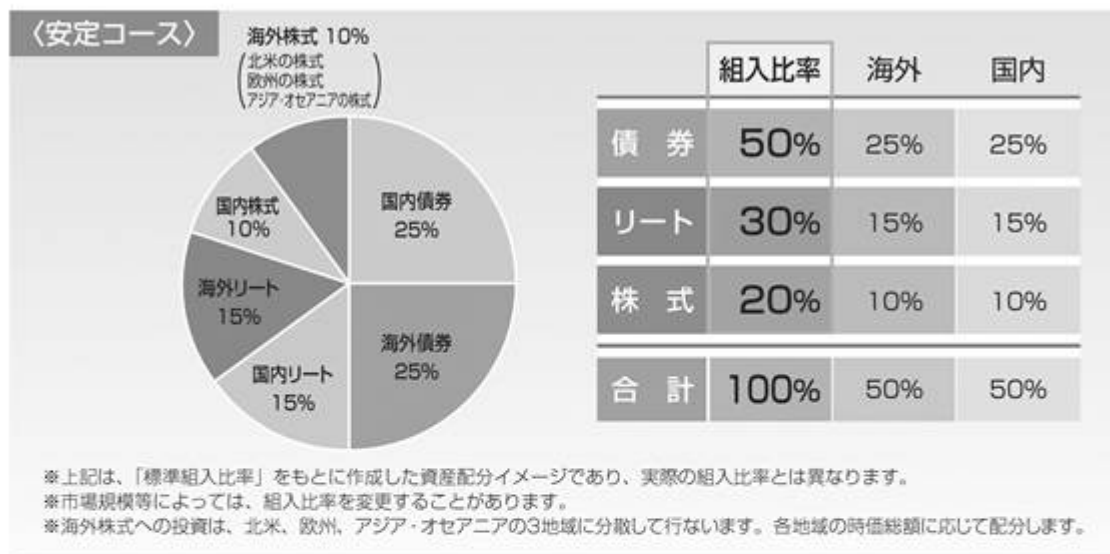
< 信託金の限度額 >

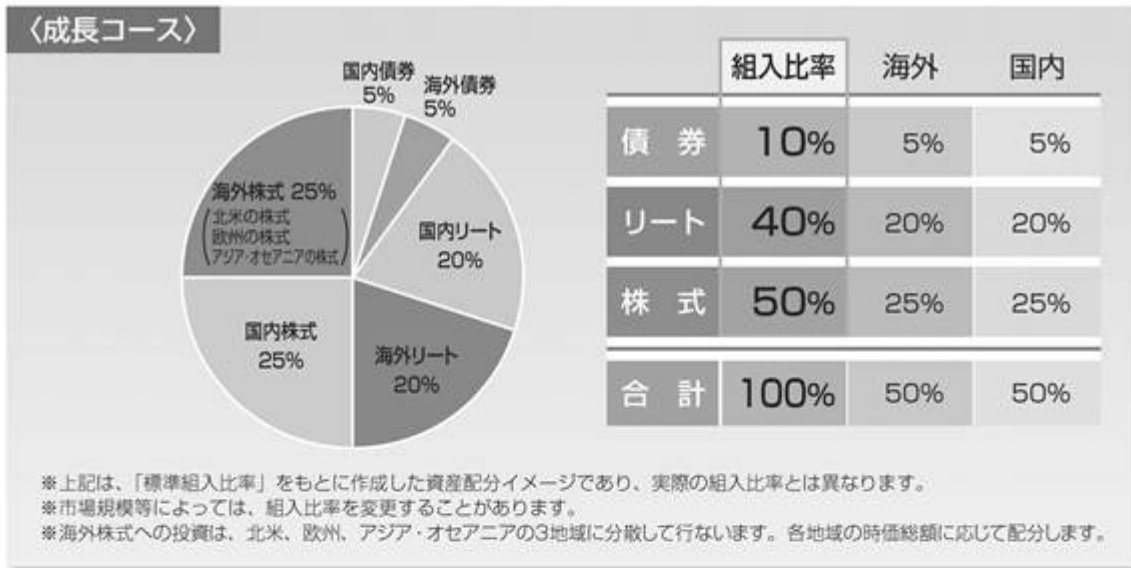
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## <ファンドの特色>

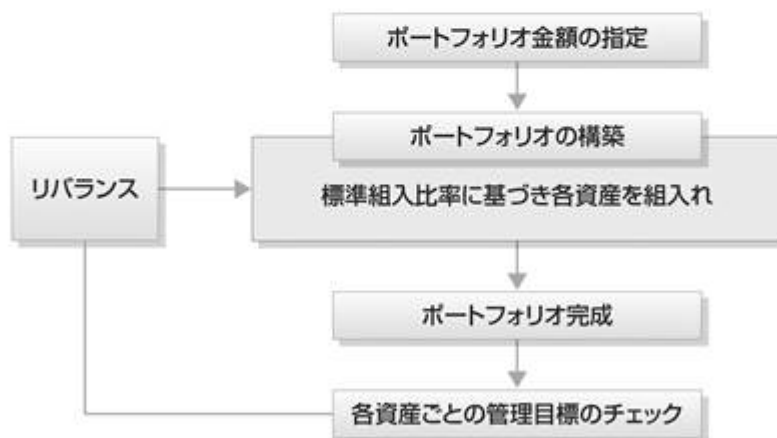
### 1 内外の債券、リートおよび株式に投資します。

- 各コース（安定コース／6分散コース／成長コース）における各資産の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処とします。





## 運用プロセス



- 標準組入比率に従って、各資産へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- 各資産ごとのウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- 各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。



## ファンドの仕組み

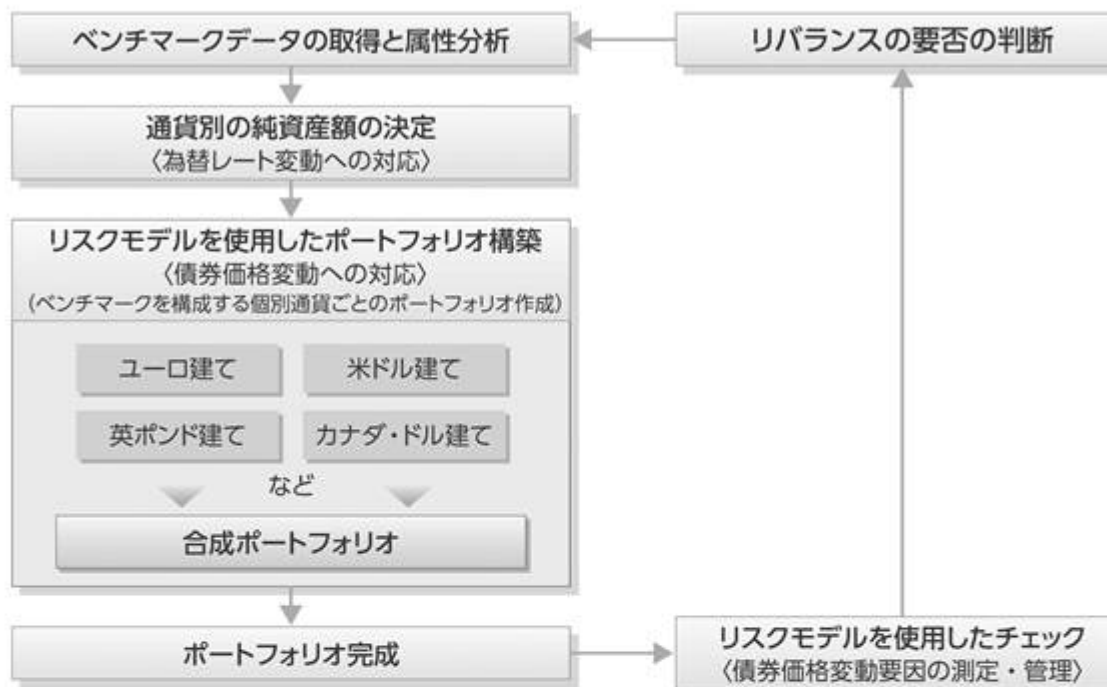
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



## 2 海外の債券への投資にあたっては、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

### 運用プロセス



ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

#### ①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

#### ②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル<sup>(注)</sup>を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

#### ③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

(注) リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響を測定・管理することなどができます。

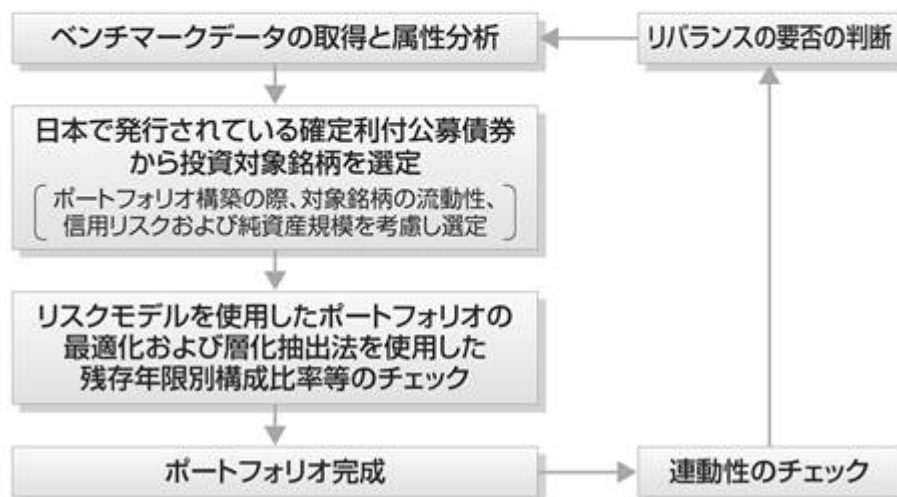
### FTSE世界国債インデックスとは

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

## 3

わが国の債券への投資にあたっては、ベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

## 運用プロセス



ポートフォリオの構築にあたっては、金利リスクや信用リスクなどのリスク特性がベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数と同程度となるように、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法<sup>(注2)</sup>と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることで、同指数との連動をめざします。また、ベンチマークの構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注1) リスクモデルとは…

債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、ベンチマークに連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

(注2) 層化抽出法とは…

ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることをめざす手法です。

・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

## NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

## 4 内外のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

- 海外のリートへの投資にあたっては、組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- 海外のリーートの運用は、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



### 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

### 〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・ 米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・ 優先証券や大型バリュー株などインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- ・ リート運用では最大級の資産規模。
- ・ ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- ・ 所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

- わが国のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 5 海外の株式への投資にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。

◆北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散投資します。各地域の時価総額に応じて配分します。



◆北米の株式の運用は、コーヘン&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

◆北米の株式への投資にあたっては、株式のほかハイブリッド優先証券<sup>®</sup>を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

- 株式と債券の両方の性質を併せ持った証券です。
- 弁済順位は、株式と債券の中間の位置付けとなります。

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

### 〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

アムンディ・アイルランド・リミテッドは、運用資産額で欧州および世界でトップクラスに入るフランスの資産運用会社アムンディ・グループの主要運用拠点のひとつで、アイルランド（ダブリン市）に所在します。

**6** わが国の株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。

### 投資対象のイメージ



※配当利回り：株式投資を行なう際に用いられる株式の投資価値を測る指標のひとつです。個別銘柄の配当利回りから株価の割安度の測定や、株式市場全体の配当利回りと市場金利を比較して、株価水準の妥当性の測定などを行なうことができます。

$$\text{配当利回り (\%)} = (\text{1株当たり年間配当金} \div \text{株価}) \times 100$$

### 銘柄選定プロセス



定量・定性分析による銘柄選定

予想配当利回り、  
成長性、企業のファンダメンタルズ、  
株価の割安性 等

• 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

• 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時、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.～6.の運用が行なわれないことがあります。

7

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

8

毎年1月10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。収益分配金は、自動的に再投資されます。

#### 〈分配方針〉

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- 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。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### (2) 【ファンドの沿革】

2006年1月12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1）、償還金など お申込金（ 5 ）

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せん。</p> <p>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 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金( 5)	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<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せん。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金( 5)
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <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</p>	<p>信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないません。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 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないません。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します(カッコ内は投資顧問会社名)。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ北米好配当株マザーファンド(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ欧州好配当株マザーファンド(アムンディ・アイルランド・リミテッド)</li> </ul>	

(注1) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

(注2) 投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約( 3)に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないません( 4)。

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: 運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4: 投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5: 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収受します。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。

#### < 委託会社の概況(2019年7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

下記の各マザーファンド(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。

1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の受益証券
3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券

4. ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

- イ. 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。
- ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率（信託財産の純資産総額に対する比率とします。）を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

	安 定 コース	6 分散 コース	成 長 コース
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券	10% （注）	16.7% （注）	25% （注）
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券	10%	16.7%	25%

（注）3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

- ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ニ. 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。

## (2) 【投資対象】

### <各ファンド共通>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 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。）

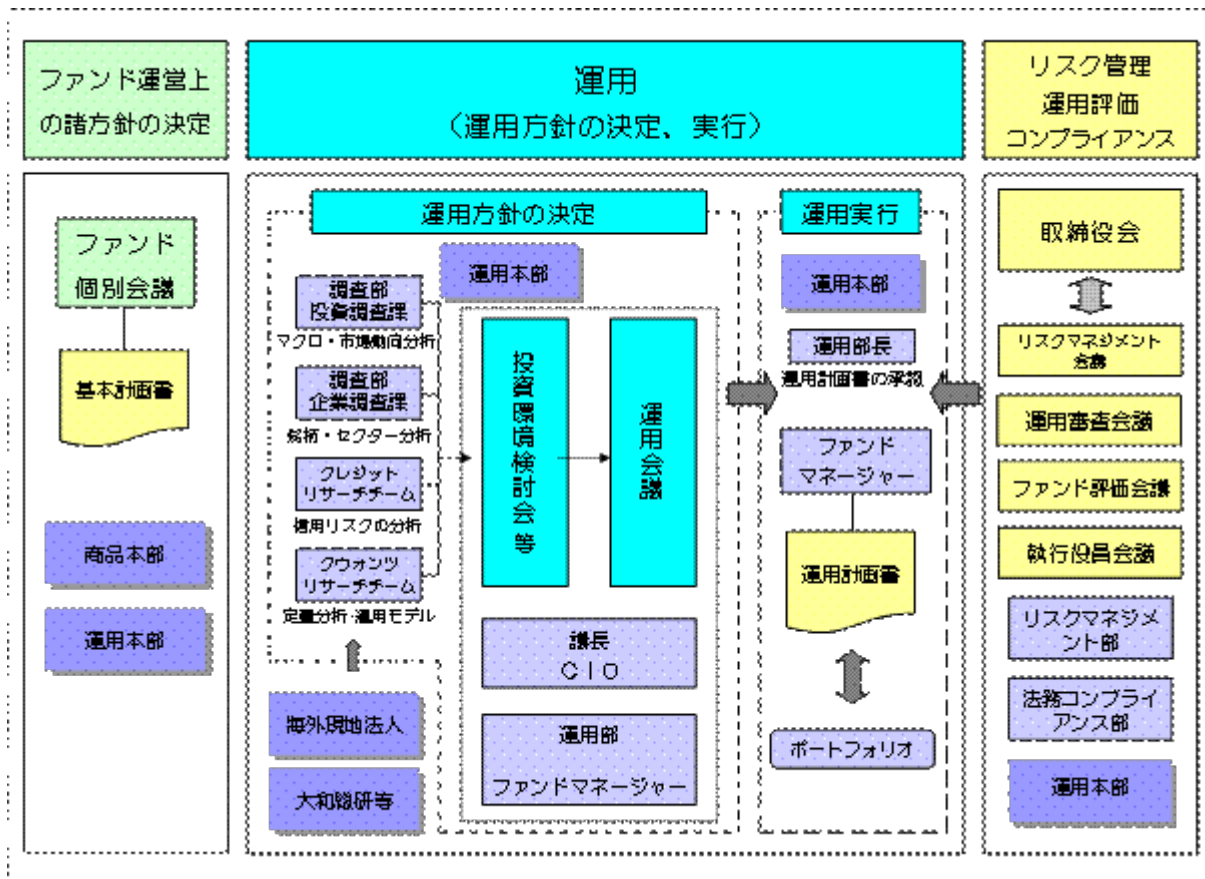
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (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．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO(Chief Investment Officer)が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

#### 八．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。

#### 二．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。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

##### イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

##### ロ．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。

##### ハ．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。

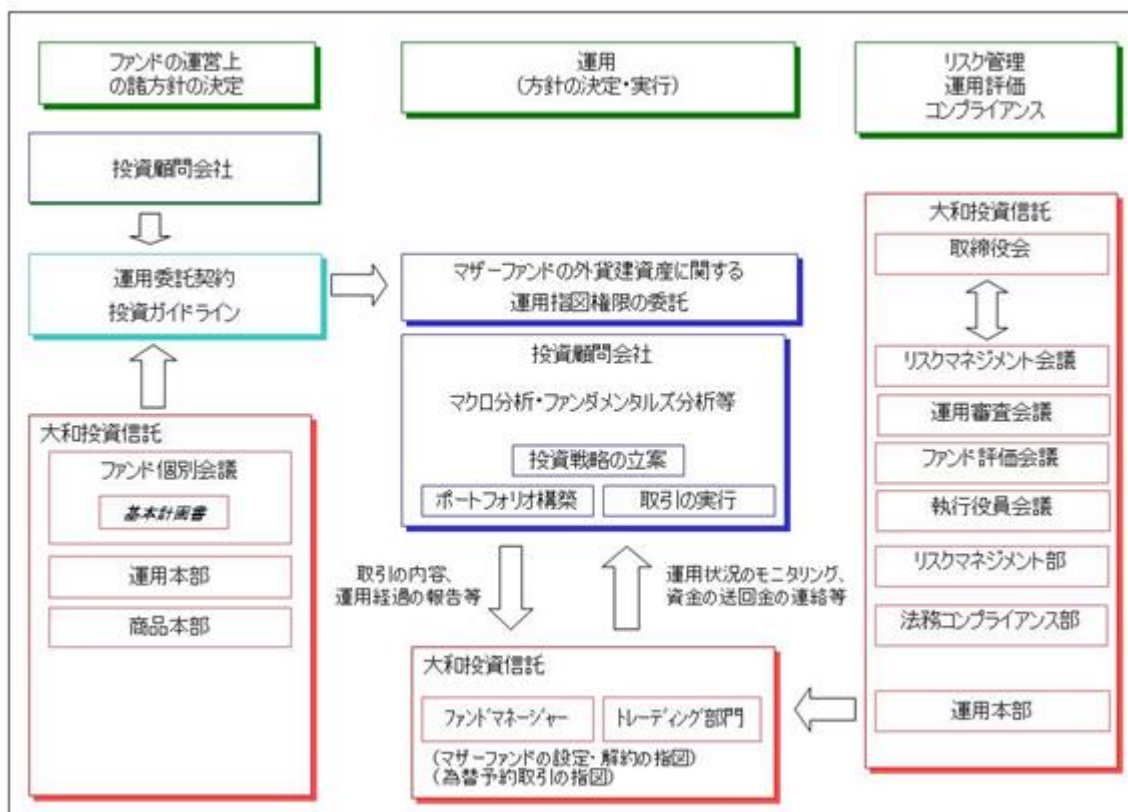
##### ニ．執行役員会議

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。

海外リート、海外（北米）株式および海外（欧州）株式にかかる運用体制について（マザーファンドにかかるものを含みます。）



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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。なお、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」および「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

#### ロ．運用の実行

投資顧問会社は、投資ガイドラインに基づき、投資戦略の立案、ポートフォリオ構築を行ない、取引を実行します。

#### ハ．モニタリング

委託会社は、投資顧問会社との間で取引の内容、運用経過の報告等を受け、資金動向等について必要な連絡を取るとともに、運用の状況、投資ガイドラインの遵守状況等をモニタリングします。

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も行なっています。これらの報告および調査をもとに評価を行ない、委託会社でのファンド個別会議へ報告しています。

## 二．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2019年7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】

#### <各ファンド共通>

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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】

#### <各ファンド共通>

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

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ます。
- 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> マザーファンドの概要

### 1. 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### 投資態度

- イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ハ．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。

#### (2) 投資対象

委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（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します。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 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。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの  
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
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

#### 株式

- イ. 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



ロ．株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号イもしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

内外の公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．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生じたとき、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。

### (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．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。)
  - ハ．約束手形
  - ニ．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、次の有価証券（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. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
14. 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。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

## 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

## (3) 主な投資制限

## 株式

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します。

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。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

## 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

## スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 金利先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

### 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。以下同じ。)および店頭登録(登録予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

ヘ．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。

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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、次の有価証券(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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 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3.の証券および前4.の証券を以下「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

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

### (4) 運用指図権限の委託

委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク  
New York, New York, USA

前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

## 4. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ. わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

ハ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態 で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします

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。

## (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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、(3)に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．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．（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

委託会社は、信託金を、次の有価証券（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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）

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2.の証券および前3.の証券を以下「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

## (3) 主な投資制限

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ．先物取引の売建の指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
- ロ．先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに(2) 1. から4. に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

主要投資対象

北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。
- ロ．銘柄の選定にあたっては、企業の本質的価値、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。
- ハ．外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ニ．株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。
- ホ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ヘ．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。

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

主要投資対象

欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。
- ロ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)



ハ．外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

#### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

##### 主要投資対象

アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主として、アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

#### (2) 投資対象

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限りません。）

ハ．約束手形

ニ．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、次の有価証券（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．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券
13. 前12.以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券、前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前14.の証券および前15.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

- 1.～11.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 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。）
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの  
なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。  
（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

##### 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

##### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

##### 先物取引等

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

八. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

## 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。

ロ．株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。

ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ニ．J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REIT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。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

ホ．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。

## (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．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。)

ハ．約束手形

ニ．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、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1．株券または新株引受権証書

2．～10．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

11．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

12．～20．(ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定)

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

## (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の

範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2) 1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) 1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、ハイブリッド優先証券、公社債、不動産投資信託証券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。

ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

ハイブリッド優先証券の価格は、金利、発行体の企業業績等を反映して変動します。一般に、金利の上昇、発行体の企業業績の悪化等は、ハイブリッド優先証券の価格下落の要因となると考えられます。

また、ハイブリッド優先証券の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、大きく下落します。この際、ハイブリッド優先証券は一般の債券に比し、弁済順位が劣後するため、影響がより大きくなる可能性があります。

組入ハイブリッド優先証券の価格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。



## 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともありま）。組入公社債の価格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。

## リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもありま

ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、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。

## 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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。

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組み入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カンントリー・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。

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) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、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があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。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

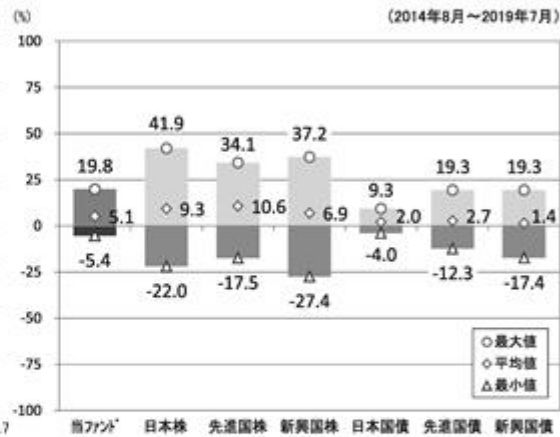
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

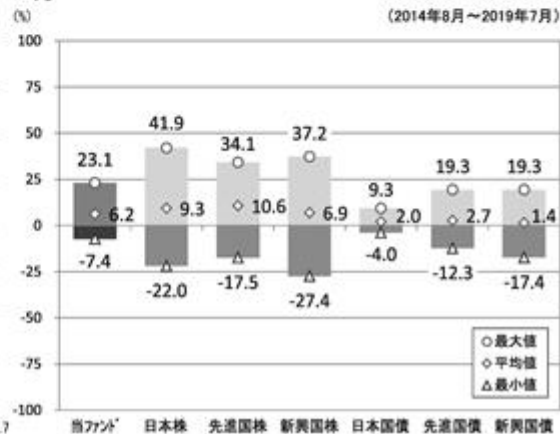
## [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）]



## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）]



## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】



※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、飛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】

取得申込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。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

## ・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。

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。

(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次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および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。

安定コース	年率0.99%（税抜0.9%）
6分散コース	年率1.155%（税抜1.05%）
成長コース	年率1.32%（税抜1.2%）

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
安定コース	年率0.45% （税抜）	年率0.4% （税抜）	年率0.05% （税抜）
6分散コース	年率0.53% （税抜）	年率0.47% （税抜）	
成長コース	年率0.61% （税抜）	年率0.54% （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。

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとし、報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとし、

イ. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

275億円以下の部分	年率0.57%
------------	---------

275億円超1,000億円以下の部分	年率0.47%
1,000億円超2,500億円以下の部分	年率0.37%
2,500億円超 4,500億円以下の部分	年率0.30%
4,500億円超の部分	年率0.25%

ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。

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（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

<マザーファンドより支弁する手数料等>

各マザー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。

(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。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

#### 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。

#### <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。

- ( ) 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2019年7月末現在のもので、税法または確定拠出年金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】

## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）】

## (1) 【投資状況】（2019年7月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,236,456,946	99.11
内 日本	4,236,456,946	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	37,908,538	0.89
純資産総額	4,274,365,484	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（2019年7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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	807,253,644	1.2840 1,036,545,805	1.3115 1,058,713,154	24.77
2	外国債券インデックスマ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	375,488,835	2.7014 1,014,362,149	2.8151 1,057,038,619	24.73
3	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	213,098,733	2.6147 557,209,114	3.0035 640,042,044	14.97
4	ダイワ・グローバルREIT・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	247,893,242	2.2104 547,950,894	2.5568 633,813,441	14.83
5	ダイワ好配当日本株マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	164,545,287	2.5433 418,497,270	2.5581 420,923,298	9.85

6	ダイワ北米好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	106,959,397	2.4829 265,578,941	2.8805 308,096,543	7.21
7	ダイワ欧州好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	61,320,549	1.4955 91,710,167	1.5979 97,984,105	2.29
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配 当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	10,091,911	1.8037 18,203,004	1.9665 19,845,742	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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4計算期間末 (2010年1月12日)	472,813,932	472,813,932	0.8958	0.8958
第5計算期間末 (2011年1月11日)	681,811,989	681,811,989	0.9146	0.9146
第6計算期間末 (2012年1月10日)	884,929,811	884,929,811	0.8535	0.8535
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,295,359,257	1,295,359,257	1.0521	1.0521

第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,780,966,415	1,780,966,415	1.3008	1.3008
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,254,707,121	2,254,707,121	1.5471	1.5471
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,390,744,550	2,390,744,550	1.4830	1.4830
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
2018年7月末日	3,410,215,528	-	1.6258	-
8月末日	3,491,615,895	-	1.6255	-
9月末日	3,576,992,259	-	1.6465	-
10月末日	3,541,578,773	-	1.6017	-
11月末日	3,674,065,052	-	1.6242	-
12月末日	3,571,416,509	-	1.5705	-
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715
2019年1月末日	3,733,923,353	-	1.6167	-
2月末日	3,825,377,142	-	1.6391	-
3月末日	3,919,162,165	-	1.6629	-
4月末日	4,010,670,812	-	1.6661	-
5月末日	4,015,527,727	-	1.6422	-
6月末日	4,119,921,320	-	1.6646	-
7月末日	4,274,365,484	-	1.6876	-

## 【分配の推移】

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

2019年1月11日～ 2019年7月10日	-
---------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	16.7
第5計算期間	2.1
第6計算期間	6.7
第7計算期間	23.3
第8計算期間	23.6
第9計算期間	18.9
第10計算期間	4.1
第11計算期間	4.9
第12計算期間	5.4
第13計算期間	4.2
2019年1月11日～ 2019年7月10日	7.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	214,143,453	38,882,696
第5計算期間	257,592,997	39,972,380
第6計算期間	379,299,436	87,980,745
第7計算期間	309,871,850	115,412,495
第8計算期間	351,397,372	213,512,755
第9計算期間	438,028,259	349,751,949
第10計算期間	345,342,005	190,621,495
第11計算期間	389,459,803	224,474,896
第12計算期間	458,208,043	289,727,307
第13計算期間	575,990,631	232,603,369
2019年1月11日～ 2019年7月10日	368,268,928	156,397,432

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2019年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	177,854,303,069	98.02
内 ユーロ	68,946,671,178	38.00
内 シンガポール	727,381,259	0.40
内 マレーシア	837,421,587	0.46
内 ノルウェー	413,618,581	0.23
内 スウェーデン	615,395,964	0.34
内 デンマーク	930,104,380	0.51
内 イギリス	11,127,873,417	6.13
内 ポーランド	1,074,489,257	0.59
内 カナダ	3,395,688,456	1.87
内 アメリカ	83,846,092,360	46.21
内 メキシコ	1,353,112,518	0.75
内 南アフリカ	1,015,874,269	0.56
内 オーストラリア	3,570,579,843	1.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,598,609,617	1.98
純資産総額	181,452,912,686	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,157,195,510	1.19
内 日本	2,157,195,510	1.19

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

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

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

## (2) 投資資産 (2019年7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)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額				
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,907,000	99.98 858,884,539	100.62 864,350,972	2.250000 2021/04/30	0.48
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	102.66 713,836,581	109.10 758,630,512	3.125000 2028/11/15	0.42
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	99.39 701,876,189	106.82 754,376,604	2.875000 2028/05/15	0.42

4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	100.58 721,223,261	104.92 752,308,751	2.625000 2029/02/15	0.41
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	91.63 699,751,061	98.03 748,655,764	1.625000 2026/05/15	0.41
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	91.26 684,100,183	97.09 727,824,662	1.500000 2026/08/15	0.40
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	97.75 669,080,190	105.78 724,053,768	2.750000 2028/02/15	0.40
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	98.64 642,974,976	106.91 696,908,217	2.875000 2028/08/15	0.38
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	96.78 661,033,276	100.57 686,912,892	2.000000 2022/11/30	0.38
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	98.11 656,837,340	102.48 686,068,561	2.375000 2024/08/15	0.38
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	159.73 596,990,811	183.27 685,005,189	4.500000 2041/04/25	0.38
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	96.38 619,984,385	101.92 655,614,415	2.250000 2024/11/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	94.14 603,466,084	101.92 653,289,148	2.250000 2027/08/15	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	95.58 606,446,296	101.93 646,747,043	2.250000 2025/11/15	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	95.35 590,459,160	102.90 637,243,346	2.375000 2027/05/15	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	95.23 598,839,315	101.26 636,762,745	2.125000 2025/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,800,000	99.16 624,869,444	100.75 634,837,840	2.000000 2024/05/31	0.35
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,087,000	118.72 588,043,264	128.06 634,285,700	2.500000 2030/05/25	0.35
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,420,000	107.50 575,836,285	117.62 630,043,056	1.500000 2031/05/25	0.35
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.71 590,964,090	100.64 627,912,604	2.000000 2025/02/15	0.35
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.26 588,137,735	100.54 627,326,120	2.000000 2025/08/15	0.35
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	97.88 590,185,387	101.24 610,440,663	2.125000 2024/03/31	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	93.94 561,340,164	101.87 608,723,500	2.250000 2027/11/15	0.34

24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	4,800,000	105.51 550,244,132	116.37 606,863,040	3.375000 2048/11/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,400,000	102.77 602,948,435	102.78 603,017,835	2.375000 2029/05/15	0.33
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,097,000	121.43 602,941,915	121.16 601,617,816	4.250000 2023/10/25	0.33
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,500,000	93.00 555,735,426	100.32 599,479,865	2.000000 2026/11/15	0.33
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	2,807,000	162.41 552,497,079	175.26 596,203,448	5.750000 2032/10/25	0.33
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,340,000	94.56 548,589,717	101.99 591,693,940	2.250000 2027/02/15	0.33
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,229,000	99.33 564,300,837	103.96 590,619,917	2.750000 2024/02/15	0.33

(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。

#### □．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
国債証券	98.02%
合計	98.02%

(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。

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2019年8 月	買建	520,000	39,414,772	38,781,600	0.02%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2019年9月	買建	1,400,000	10,626,280	10,626,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2019年9月	買建	639,000	52,706,509	52,717,500	0.03%



デンマーク・クローネ 買/円売 2019年8月	買建	313,000	5,086,625	5,079,990	0.00%
デンマーク・クローネ 買/円売 2019年9月	買建	1,041,000	16,890,953	16,895,430	0.01%
ユーロ買/円売 2019年8 月	買建	6,032,000	734,435,439	731,018,080	0.40%
英ポンド買/円売 2019年 8月	買建	792,000	107,236,492	104,512,320	0.06%
メキシコ・ペソ買/円売 2019年9月	買建	4,687,000	26,482,070	26,434,680	0.01%
メキシコ・ペソ買/円売 2019年8月	買建	1,299,000	7,414,432	7,391,310	0.00%
ノルウェー・クローネ 買/円売 2019年9月	買建	1,477,000	18,276,870	18,270,490	0.01%
ポーランド・ズロチ買/ 円売 2019年8月	買建	697,000	19,809,814	19,641,460	0.01%
スウェーデン・クローネ 買/円売 2019年9月	買建	529,000	6,005,726	6,004,150	0.00%
シンガポール・ドル買/ 円売 2019年8月	買建	300,000	23,839,500	23,772,000	0.01%
米ドル買/円売 2019年8 月	買建	10,051,000	1,084,493,764	1,091,752,180	0.60%
カナダ・ドル買/円売 2019年8月	買建	52,000	4,301,596	4,298,320	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。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

#### (1) 投資状況 (2019年7月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	15,645,574,410	83.04
内 日本	15,645,574,410	83.04
地方債証券	1,141,090,000	6.06
内 日本	1,141,090,000	6.06
特殊債券	836,896,300	4.44

	内 日本	836,896,300	4.44
社債券		1,043,144,100	5.54
	内 日本	1,043,144,100	5.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		175,403,164	0.93
純資産総額		18,842,107,974	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (2019年7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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	125 5年国債	日本	国債証券	370,000,000	100.44 371,631,700	100.32 371,198,800	0.100000 2020/09/20	1.97
2	345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.90 285,325,300	102.63 287,372,400	0.100000 2026/12/20	1.53
3	126 5年国債	日本	国債証券	233,000,000	100.50 234,170,050	100.39 233,922,680	0.100000 2020/12/20	1.24
4	334 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	103.90 228,582,020	104.17 229,189,400	0.600000 2024/06/20	1.22
5	135 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	100.98 201,965,500	101.24 202,492,000	0.100000 2023/03/20	1.07
6	130 5年国債	日本	国債証券	197,000,000	100.70 198,384,910	100.74 198,463,710	0.100000 2021/12/20	1.05
7	343 10年国債	日本	国債証券	192,000,000	101.06 194,039,280	102.48 196,775,040	0.100000 2026/06/20	1.04
8	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.81 191,543,000	100.83 191,584,600	0.100000 2022/03/20	1.02
9	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	100.46 185,854,700	102.77 190,124,500	0.100000 2028/03/20	1.01
10	128 5年国債	日本	国債証券	187,000,000	100.59 188,112,600	100.56 188,060,290	0.100000 2021/06/20	1.00
11	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.89 181,615,150	102.77 184,991,400	0.100000 2027/06/20	0.98
12	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.64 183,170,400	100.66 183,210,300	0.100000 2021/09/20	0.97

13	349 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.58 170,996,200	102.82 174,795,700	0.100000 2027/12/20	0.93
14	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.84 171,432,600	102.77 174,724,300	0.100000 2027/09/20	0.93
15	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	104.18 166,688,000	104.07 166,524,800	0.800000 2023/06/20	0.88
16	335 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.43 165,500,800	103.90 166,243,200	0.500000 2024/09/20	0.88
17	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.50 165,614,400	103.23 165,180,800	0.800000 2022/09/20	0.88
18	352 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.70 161,126,700	102.74 164,390,400	0.100000 2028/09/20	0.87
19	139 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.53 152,303,600	101.61 152,424,000	0.100000 2024/03/20	0.81
20	138 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	101.31 151,972,800	101.52 152,293,500	0.100000 2023/12/20	0.81
21	133 5年国債	日本	国債証券	150,000,000	100.85 151,287,000	101.04 151,563,000	0.100000 2022/09/20	0.80
22	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.74 145,244,400	103.12 144,380,600	1.100000 2021/12/20	0.77
23	322 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	103.38 144,744,600	102.93 144,113,200	0.900000 2022/03/20	0.76
24	127 5年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.54 140,760,050	100.48 140,676,200	0.100000 2021/03/20	0.75
25	331 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	103.42 134,451,200	103.50 134,561,700	0.600000 2023/09/20	0.71
26	351 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.65 130,854,000	102.76 133,588,000	0.100000 2028/06/20	0.71
27	353 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	101.35 131,761,100	102.72 133,538,600	0.100000 2028/12/20	0.71
28	137 5年国債	日本	国債証券	130,000,000	100.98 131,283,400	101.44 131,873,300	0.100000 2023/09/20	0.70
29	113 20年国債	日本	国債証券	100,000,000	121.34 121,347,200	123.03 123,033,000	2.100000 2029/09/20	0.65
30	149 20年国債	日本	国債証券	100,000,000	118.42 118,423,760	121.78 121,783,000	1.500000 2034/06/20	0.65

(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。

#### □．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
-----------	------

国債証券	83.04%
地方債証券	6.06%
特殊債券	4.44%
社債券	5.54%
合計	99.07%

(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。

#### 八．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。

#### ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資状況（2019年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	88,242,180,099	97.13
内 香港	5,680,140,434	6.25
内 シンガポール	5,346,725,942	5.89
内 イギリス	6,810,275,760	7.50
内 オランダ	300,677,080	0.33
内 ベルギー	1,368,192,393	1.51
内 フランス	6,814,331,108	7.50
内 ドイツ	1,143,127,062	1.26
内 スペイン	1,496,792,684	1.65
内 カナダ	3,009,189,004	3.31
内 アメリカ	45,756,983,530	50.37
内 オーストラリア	10,431,485,496	11.48
内 ニュージーランド	84,259,606	0.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,604,413,904	2.87
純資産総額	90,846,594,003	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)		133,062,289	0.15
	内 日本	133,062,289	0.15
為替予約取引(売建)		133,071,613	0.15
	内 日本	133,071,613	0.15

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

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

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

## (2) 投資資産 (2019年7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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	LINK REIT	香港	投資証券	3,526,305	1,213.29 4,278,435,883	1,281.35 4,518,439,728	4.97
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	424,994	8,555.50 3,636,043,825	9,120.32 3,876,084,678	4.27
3	UDR INC	アメリカ	投資証券	686,757	4,924.65 3,382,038,684	5,062.62 3,476,792,470	3.83
4	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	378,841	7,798.17 2,954,270,006	8,909.56 3,375,309,045	3.72
5	KLEPIERRE	フランス	投資証券	956,687	3,740.04 3,578,133,004	3,432.10 3,283,446,218	3.61
6	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	94,697	31,606.63 2,993,053,534	33,317.71 3,155,087,676	3.47
7	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,715,083	218.54 2,341,995,992	241.67 2,589,531,253	2.85
8	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	201,295	10,869.43 2,187,962,314	12,156.81 2,447,106,277	2.69
9	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	773,179	2,592.15 2,004,196,254	3,015.84 2,331,789,104	2.57
10	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	156,313	12,777.15 1,997,234,710	14,498.00 2,266,227,125	2.49
11	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	84,508	23,930.13 2,022,297,013	26,410.38 2,231,888,731	2.46

12	COVIVIO	フランス	投資証券	195,484	11,310.29 2,210,987,659	11,307.02 2,210,342,866	2.43
13	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	1,845,608	989.06 1,825,423,324	1,109.89 2,048,438,843	2.25
14	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,082,569	704.12 1,466,398,477	858.53 1,787,949,838	1.97
15	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,601,547	883.40 1,414,818,124	1,032.26 1,653,227,864	1.82
16	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	11,934,213	114.92 1,371,563,297	137.91 1,645,875,957	1.81
17	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	3,999.57 1,613,300,407	4,044.21 1,631,307,481	1.80
18	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	187,141	8,200.14 1,534,583,747	8,697.71 1,627,699,719	1.79
19	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	6,011,756	222.27 1,336,282,303	252.86 1,520,133,223	1.67
20	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	6,252,477	227.87 1,424,817,123	242.53 1,516,448,261	1.67
21	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	12,282,483	130.53 1,603,263,212	123.44 1,516,228,923	1.67
22	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	242,523	5,630.81 1,365,601,225	6,068.63 1,471,782,450	1.62
23	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	1,428,138	899.53 1,284,762,698	1,003.83 1,433,612,910	1.58
24	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	397,407	3,354.74 1,333,200,577	3,467.17 1,377,881,523	1.52
25	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	78,890	18,678.90 1,473,585,957	17,405.21 1,373,097,364	1.51
26	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	24,768	48,201.50 1,193,856,963	54,191.80 1,342,222,621	1.48
27	GECINA SA	フランス	投資証券	77,999	15,937.69 1,243,133,060	16,930.24 1,320,542,024	1.45
28	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	557,963	2,328.58 1,299,316,544	2,334.67 1,302,661,486	1.43
29	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	224,920	5,512.82 1,239,951,914	5,435.25 1,222,498,499	1.35
30	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	161,293	7,096.36 1,144,593,968	7,271.27 1,172,805,791	1.29

(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。

## □．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
投資証券	97.13%
合計	97.13%

(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。

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2019年8月	買建	1,097,964	133,083,863	133,062,289	0.15%
		米ドル売/円買 2019年8月	売建	1,224,999	133,083,863	133,071,613	0.15%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2019年7月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	122,832,185,520	98.81
内 日本	122,832,185,520	98.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,475,517,030	1.19
純資産総額	124,307,702,550	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (2019年7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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	16,968	616,415.68 10,459,341,309	681,000.00 11,555,208,000	9.30
2	野村不動産マスターF	日本	投資証券	51,988	164,003.79 8,526,229,139	172,900.00 8,988,725,200	7.23
3	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	24,526	254,000.16 6,229,608,011	266,500.00 6,536,179,000	5.26
4	日本プロロジスリート	日本	投資証券	24,427	240,910.26 5,884,715,034	261,700.00 6,392,545,900	5.14
5	オリックス不動産投資	日本	投資証券	26,409	195,131.77 5,153,235,011	211,300.00 5,580,221,700	4.49
6	日本ビルファンド	日本	投資証券	7,199	715,000.00 5,147,285,000	764,000.00 5,500,036,000	4.42
7	日本リテールファンド	日本	投資証券	22,940	212,048.91 4,864,402,097	218,800.00 5,019,272,000	4.04
8	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	5,859	753,398.82 4,414,163,726	782,000.00 4,581,738,000	3.69
9	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,777	149,288.43 4,146,784,939	160,300.00 4,452,653,100	3.58
10	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	41,007	82,054.53 3,364,810,385	84,400.00 3,460,990,800	2.78
11	API投資法人	日本	投資証券	6,546	466,854.68 3,056,030,738	499,500.00 3,269,727,000	2.63
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	6,512	447,500.00 2,914,120,000	481,500.00 3,135,528,000	2.52
13	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	158,563	16,910.75 2,681,419,395	19,340.00 3,066,608,420	2.47
14	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	48,133	55,984.74 2,694,713,638	62,500.00 3,008,312,500	2.42
15	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,809	312,610.96 2,753,790,000	337,500.00 2,973,037,500	2.39
16	森トラスト総合リート	日本	投資証券	16,064	169,190.57 2,717,877,333	181,100.00 2,909,190,400	2.34
17	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	14,595	178,800.00 2,609,586,000	184,100.00 2,686,939,500	2.16



18	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	27,290	88,800.00 2,423,352,000	90,800.00 2,477,932,000	1.99
19	星野リゾート・リート	日本	投資証券	4,373	535,563.64 2,342,019,817	563,000.00 2,461,999,000	1.98
20	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	26,829	86,051.70 2,308,681,176	91,400.00 2,452,170,600	1.97
21	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	12,336	181,155.57 2,234,735,152	192,600.00 2,375,913,600	1.91
22	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	11,976	180,833.20 2,165,658,509	194,200.00 2,325,739,200	1.87
23	三井不ロジパーク	日本	投資証券	5,747	359,086.58 2,063,670,631	393,500.00 2,261,444,500	1.82
24	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,580	759,000.00 1,958,220,000	805,000.00 2,076,900,000	1.67
25	福岡リート投資法人	日本	投資証券	10,710	171,415.17 1,835,856,568	180,100.00 1,928,871,000	1.55
26	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	13,849	120,791.25 1,672,838,042	136,300.00 1,887,618,700	1.52
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	5,799	299,967.06 1,739,508,988	325,500.00 1,887,574,500	1.52
28	産業ファンド	日本	投資証券	11,933	130,031.59 1,551,667,075	142,400.00 1,699,259,200	1.37
29	GLP投資法人	日本	投資証券	13,793	122,697.94 1,692,372,768	121,400.00 1,674,470,200	1.35
30	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,570	459,500.00 1,640,415,000	469,000.00 1,674,330,000	1.35

(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
投資証券	98.81%
合計	98.81%

(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。

### ダイワ北米好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（2019年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,833,570,668	71.89
内 カナダ	34,728,544	1.36
内 アメリカ	1,798,842,124	70.53
ハイブリッド優先証券	532,537,580	20.88
内 アメリカ	532,537,580	20.88
投資証券	51,319,539	2.01
内 アメリカ	51,319,539	2.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	132,926,968	5.21
純資産総額	2,550,354,755	100.00

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

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

#### (2) 投資資産（2019年7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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	3,135	21,736.90 68,145,401	22,748.12 71,315,386	2.80
2	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	4,305	14,680.95 63,201,780	15,745.19 67,783,065	2.66
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	4,409	13,140.00 57,934,295	15,247.62 67,226,774	2.64
4	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,209	17,372.83 55,749,611	19,721.41 63,286,034	2.48

5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	470	132,837.38 62,433,572	133,409.92 62,702,662	2.46
6	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	1,902	27,866.92 53,003,079	32,552.88 61,915,596	2.43
7	DOLLAR TREE INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	4,980	11,412.19 56,832,752	11,025.87 54,908,851	2.15
8	HERSHEY CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	3,318	13,194.65 43,780,112	16,541.52 54,884,785	2.15
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技 術	1,643	32,864.36 53,996,168	32,544.19 53,470,118	2.10
10	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	232	200,050.56 46,411,754	206,256.29 47,851,461	1.88
11	CVS HEALTH CORP	アメリカ	株式	ヘルス ケア	7,480	5,737.27 42,914,842	6,141.41 45,937,816	1.80
12	TYSON FOODS INC-CL A	アメリカ	株式	生活必 需品	5,173	7,857.27 40,646,188	8,835.69 45,707,031	1.79
13	WILLIS TOWERS WATSON PLC	アメリカ	株式	金融	2,118	19,633.42 41,583,585	21,455.31 45,442,354	1.78
14	NORTHROP GRUMMAN CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	1,158	30,911.33 35,795,427	38,340.14 44,397,885	1.74
15	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技 術	1,947	21,605.23 42,065,396	22,681.85 44,161,580	1.73
16	MOTOROLA SOLUTIONS INC	アメリカ	株式	情報技 術	2,447	15,560.50 38,076,561	18,034.24 44,129,785	1.73
17	COLGATE-PALMOLIVE CO	アメリカ	株式	生活必 需品	5,278	7,550.04 39,849,438	8,119.75 42,856,060	1.68
18	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	6,696	6,115.34 40,948,354	6,134.90 41,079,296	1.61
19	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	アメリカ	株式	ヘルス ケア	2,144	17,105.36 36,673,909	18,536.15 39,741,520	1.56
20	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,970	8,395.69 33,330,926	9,546.19 37,898,401	1.49

21	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	3,337	9,424.52 31,449,623	11,271.40 37,612,662	1.47
22	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	6,486	4,929.75 31,975,040	5,616.68 36,429,838	1.43
23	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルス ケア	2,484	14,772.86 36,695,802	14,349.17 35,643,341	1.40
24	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必 需品	3,635	9,266.23 33,683,052	9,375.63 34,080,422	1.34
25	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	6,704	5,072.40 34,005,380	4,852.94 32,534,169	1.28
26	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	アメリカ	株式	素材	1,109	21,093.54 23,392,739	25,183.83 27,928,877	1.10
27	AMERICAN EXPRESS CO	アメリカ	株式	金融	2,028	12,049.26 24,435,904	13,739.70 27,864,113	1.09
28	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	6,952	3,497.12 24,312,810	3,713.31 25,814,967	1.01
29	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	1,935	12,434.93 24,061,598	13,016.15 25,186,267	0.99
30	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	7,462	3,277.66 24,457,965	3,355.88 25,041,648	0.98

(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
株式	71.89%
ハイブリッド優先証券	20.88%
投資証券	2.01%
合計	94.79%

(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

業種	投資比率
エネルギー	4.42%
素材	2.00%
資本財・サービス	3.67%
一般消費財・サービス	4.71%

生活必需品	6.96%
ヘルスケア	12.78%
金融	10.43%
情報技術	16.61%
コミュニケーション・サービス	6.98%
公益事業	3.33%
合計	71.89%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（2019年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,114,739,233	89.95
内 スウェーデン	4,466,047	0.36
内 イギリス	245,463,251	19.81
内 オランダ	153,980,714	12.43
内 フランス	176,001,333	14.20
内 ドイツ	185,013,084	14.93
内 スイス	234,937,965	18.96
内 スペイン	23,468,646	1.89
内 イタリア	77,622,604	6.26
内 フィンランド	13,785,589	1.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	124,529,794	10.05
純資産総額	1,239,269,027	100.00

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

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

#### (2) 投資資産（2019年7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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,858	10,482.50 61,406,525	11,537.01 67,583,817	5.45
2	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	3,798	12,294.72 46,695,367	13,561.16 51,505,289	4.16
3	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	8,924.43 41,730,642	9,377.68 43,850,042	3.54
4	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	8,888.13 39,010,003	9,956.90 43,700,835	3.53
5	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	8,394	4,268.31 35,828,209	5,134.21 43,096,595	3.48
6	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	3,271.53 38,476,538	3,447.05 40,540,830	3.27
7	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	277,616.90 38,311,132	291,881.80 40,279,688	3.25
8	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,034	34,795.38 35,978,426	38,076.31 39,370,905	3.18
9	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	29,235.36 38,386,116	29,221.09 38,367,303	3.10
10	DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	21,145	1,797.00 37,997,677	1,804.27 38,151,431	3.08
11	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	869.28 37,730,505	877.33 38,079,916	3.07
12	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,047.11 32,549,186	2,281.49 36,275,808	2.93
13	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	6,299	6,058.28 38,161,157	5,724.40 36,058,056	2.91
14	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	679.87 32,738,064	747.62 36,000,198	2.90
15	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	12,586.79 35,243,022	12,072.94 33,804,254	2.73

16	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,682	9,137.72 33,645,107	9,159.54 33,725,427	2.72
17	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,206.53 32,753,856	2,243.49 33,302,366	2.69
18	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,239	25,958.89 32,163,075	26,443.65 32,763,692	2.64
19	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	25,249.81 28,911,046	25,328.71 29,001,373	2.34
20	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	87,929	334.84 29,442,846	313.03 27,524,746	2.22
21	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	8,627.75 31,715,764	7,324.72 26,925,684	2.17
22	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	14,849	1,916.74 28,461,687	1,708.05 25,362,861	2.05
23	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	9,124.39 27,336,688	8,133.06 24,366,650	1.97
24	ENAGAS SA	スペイン	株式	公益事業	10,115	3,063.68 30,989,156	2,320.18 23,468,646	1.89
25	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,620	13,500.56 21,870,917	14,009.56 22,695,494	1.83
26	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	551.63 22,434,428	538.43 21,897,719	1.77
27	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	5,612.91 22,395,530	5,031.80 20,076,917	1.62
28	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	5,047	4,076.55 20,574,365	3,930.06 19,835,046	1.60
29	ALSTOM	フランス	株式	資本財・サービス	4,147	4,933.64 20,459,825	4,725.19 19,595,397	1.58
30	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	コミュニケーション・サービス	96,642	185.41 17,924,253	199.59 19,288,915	1.56

(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。

#### □ . 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
株式	89.95%
合計	89.95%

(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。

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	8.23%
素材	9.58%
資本財・サービス	7.85%
一般消費財・サービス	3.92%
生活必需品	8.35%
ヘルスケア	16.20%
金融	20.25%
情報技術	2.94%
コミュニケーション・サービス	6.86%
公益事業	5.77%
合計	89.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（2019年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	713,278,215	94.12
内 韓国	122,314,368	16.14
内 中国	97,374,209	12.85
内 台湾	173,192,600	22.85
内 香港	64,514,467	8.51
内 シンガポール	64,262,502	8.48



	内 オーストラリア	191,620,069	25.29
投資証券		14,872,649	1.96
	内 オーストラリア	14,872,649	1.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		29,657,094	3.91
純資産総額		757,807,958	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (2019年7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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技 術	14,050	4,310.86 60,567,612	4,282.60 60,170,530	7.94
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	66,000	888.40 58,635,147	910.00 60,060,000	7.93
3	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	34,800	1,106.03 38,490,334	1,146.61 39,902,359	5.27
4	BHP GROUP LTD	オース トラリア	株式	素材	12,400	2,930.19 36,335,084	3,045.50 37,764,320	4.98
5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オース トラリア	株式	金融	3,650	5,425.07 19,801,799	6,220.80 22,705,942	3.00
6	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	オース トラリア	株式	金融	32,429	584.03 18,942,088	648.18 21,020,059	2.77
7	WESTPAC BANKING CORP	オース トラリア	株式	金融	8,600	1,933.37 16,627,006	2,163.11 18,602,746	2.45
8	NANYA TECHNOLOGY CORP	台湾	株式	情報技 術	64,000	241.31 15,444,034	265.30 16,979,200	2.24
9	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技 術	14,000	1,053.78 14,753,057	1,139.25 15,949,500	2.10
10	TELSTRA CORP LTD	オース トラリア	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	53,200	268.00 14,259,247	294.63 15,674,343	2.07
11	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オース トラリア	株式	金融	7,300	1,872.58 13,670,196	2,137.00 15,600,126	2.06

12	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	7,300	2,114.65 15,436,995	2,124.16 15,506,426	2.05
13	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	900	14,758.37 13,282,540	17,172.10 15,454,899	2.04
14	KEPPEL CORP LTD	シンガポール	株式	資本財・サービス	29,400	525.33 15,446,608	514.39 15,123,284	2.00
15	VENTURE CORP LTD	シンガポール	株式	情報技術	12,000	1,478.99 17,747,899	1,254.68 15,056,230	1.99
16	LENOVO GROUP LTD	中国	株式	情報技術	168,000	88.49 14,867,418	88.61 14,887,858	1.96
17	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	-	13,400	978.47 13,113,211	1,109.89 14,872,649	1.96
18	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	28,000	548.34 15,353,741	521.50 14,602,000	1.93
19	HYUNDAI MOBIS CO LTD	韓国	株式	一般消費財・サービス	650	21,293.68 13,840,897	22,448.00 14,591,200	1.93
20	BGF RETAIL CO LTD	韓国	株式	生活必需品	761	18,828.42 14,328,431	18,998.00 14,457,478	1.91
21	LARGAN PRECISION CO LTD	台湾	株式	情報技術	1,000	14,786.57 14,786,573	14,437.50 14,437,500	1.91
22	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	台湾	株式	生活必需品	13,000	1,070.55 13,917,292	1,072.75 13,945,750	1.84
23	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,000	2,692.54 10,770,424	2,971.66 11,886,662	1.57
24	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,600	2,138.43 11,975,235	2,099.59 11,757,745	1.55
25	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	3,300	3,418.32 11,280,478	3,220.00 10,626,000	1.40
26	COCHLEAR LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	600	12,314.80 7,388,885	16,792.44 10,075,468	1.33
27	HKBN LTD	香港	株式	コミュニケーション・サービス	46,500	170.29 7,918,550	197.51 9,184,485	1.21

28	WPG HOLDINGS LTD	台湾	株式	情報技術	63,000	141.75 8,930,250	145.25 9,150,750	1.21
29	NISSIN FOODS CO LTD	香港	株式	生活必需品	109,000	70.06 7,637,394	76.39 8,327,055	1.10
30	WIWYNN CORP	台湾	株式	情報技術	6,000	1,269.47 7,616,844	1,333.50 8,001,000	1.06

(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
株式	94.12%
投資証券	1.96%
合計	96.09%

(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

業種	投資比率
エネルギー	0.99%
素材	4.98%
資本財・サービス	5.69%
一般消費財・サービス	7.43%
生活必需品	7.87%
ヘルスケア	5.40%
金融	23.45%
情報技術	32.26%
コミュニケーション・サービス	4.22%
不動産	1.84%
合計	94.12%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

## (1) 投資状況（2019年7月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	16,496,574,770	95.73
内 日本	16,496,574,770	95.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	735,003,493	4.27
純資産総額	17,231,578,263	100.00

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

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

## (2) 投資資産（2019年7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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	85,000	4,618.00 392,530,000	4,922.00 418,370,000	2.43
2	東京海上HD	日本	株式	保険業	69,600	5,717.00 397,903,200	5,797.00 403,471,200	2.34
3	武田薬品	日本	株式	医薬品	110,000	4,277.00 470,470,000	3,635.00 399,850,000	2.32
4	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	52,200	6,831.00 356,578,200	7,024.00 366,652,800	2.13
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	664,700	563.50 374,558,450	524.20 348,435,740	2.02
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	89,300	3,996.00 356,842,800	3,807.00 339,965,100	1.97
7	ヤフー	日本	株式	情報・通 信業	1,045,700	293.51 306,927,406	321.00 335,669,700	1.95
8	住友商事	日本	株式	卸売業	168,200	1,600.00 269,120,000	1,623.50 273,072,700	1.58
9	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	95,000	2,385.00 226,575,000	2,853.50 271,082,500	1.57
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	88,300	3,059.00 270,109,700	2,936.50 259,292,950	1.50

11	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	55,100	3,090.00 170,259,000	4,270.00 235,277,000	1.37
12	三井物産	日本	株式	卸売業	119,000	1,786.50 212,593,500	1,779.00 211,701,000	1.23
13	オリックス	日本	株式	その他 金融業	135,000	1,605.50 216,742,500	1,561.50 210,802,500	1.22
14	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	77,600	3,119.00 242,034,400	2,710.50 210,334,800	1.22
15	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	222,200	923.10 205,114,770	934.00 207,534,800	1.20
16	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	50,000	4,061.47 203,073,786	4,017.00 200,850,000	1.17
17	三洋貿易	日本	株式	卸売業	81,600	2,135.96 174,294,432	2,447.00 199,675,200	1.16
18	MS & AD	日本	株式	保険業	55,000	3,423.00 188,265,000	3,581.00 196,955,000	1.14
19	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	10,000	17,565.00 175,650,000	18,695.00 186,950,000	1.08
20	第一工業製薬	日本	株式	化学	57,000	3,693.65 210,538,371	3,240.00 184,680,000	1.07
21	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	39,400	4,862.30 191,574,828	4,638.00 182,737,200	1.06
22	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	67,500	2,304.50 155,553,750	2,615.00 176,512,500	1.02
23	阪和興業	日本	株式	卸売業	57,300	3,329.65 190,788,959	2,988.00 171,212,400	0.99
24	三井住友トラストHD	日本	株式	銀行業	45,100	3,926.23 177,073,246	3,734.00 168,403,400	0.98
25	三井化学	日本	株式	化学	66,300	2,856.74 189,402,337	2,508.00 166,280,400	0.96
26	SBIホールディングス	日本	株式	証券、商 品先物 取引業	65,000	2,444.00 158,860,000	2,494.00 162,110,000	0.94
27	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	66,800	2,624.50 175,316,600	2,419.50 161,622,600	0.94
28	パルグループHLDGS	日本	株式	小売業	46,900	3,410.27 159,942,122	3,405.00 159,694,500	0.93
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	100,000	1,577.50 157,750,000	1,553.50 155,350,000	0.90

30	豊田自動織機	日本	株式	輸送用 機器	26,700	6,158.06 164,420,400	5,670.00 151,389,000	0.88
----	--------	----	----	-----------	--------	-------------------------	-------------------------	------

(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
株式	95.73%
合計	95.73%

(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

業種	投資比率
鉱業	0.42%
建設業	4.42%
食料品	1.40%
繊維製品	0.85%
化学	12.37%
医薬品	4.98%
石油・石炭製品	1.25%
ゴム製品	0.71%
ガラス・土石製品	1.63%
鉄鋼	0.62%
非鉄金属	1.83%
金属製品	2.84%
機械	3.73%
電気機器	7.54%
輸送用機器	7.42%
精密機器	0.30%
その他製品	1.25%
陸運業	1.90%
情報・通信業	8.41%
卸売業	13.12%
小売業	1.43%
銀行業	6.31%
証券、商品先物取引業	0.94%
保険業	4.38%
その他金融業	2.30%
不動産業	1.37%
サービス業	2.00%

合計	95.73%
----	--------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

2019年7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	16,876円
純資産総額	42億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	1.3%
6カ月間	4.4%
1年間	3.8%
3年間	12.3%
5年間	23.1%
設定来	68.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	08年1月	09年1月	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

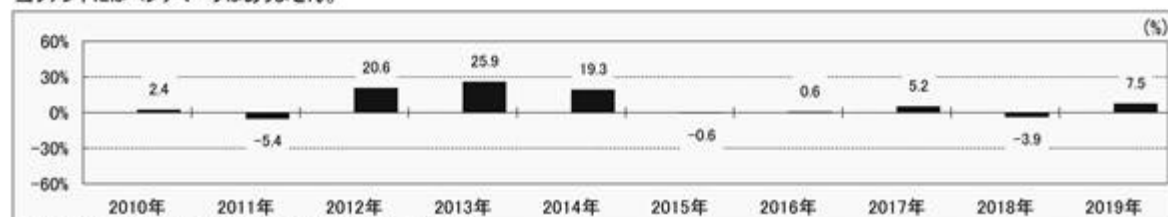
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	269	24.5%	日本円	50.8%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	0.2%	
外国債券	774	24.2%	米ドル	26.2%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.2%	
外国リート等	136	16.1%	ユーロ	12.7%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.2%	
国内リート	49	14.8%	英ポンド	3.2%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.2%	
国内株式	164	9.4%	豪ドル	2.4%	債券格付別構成	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	0.2%	
外国株式	148	7.7%	カナダドル	1.2%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.4%
			シンガポール・ドル	1.1%	AA	6.7%	野村不動産マスターF	日本	1.1%
			香港ドル	1.0%	A	6.6%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.8%
			スイス・フラン	0.5%	BBB	0.3%	日本プロジスリート	日本	0.8%
コール・ローン、その他	3.3%		その他	1.1%	BB以下・無格付	2.0%	LINK REIT	香港	0.7%
合計	1,540	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	5.9%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンド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。

※2019年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

## (1) 【投資状況】(2019年7月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	5,006,278,052	99.12



	内 日本	5,006,278,052	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		44,692,329	0.88
純資産総額		5,050,970,381	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】 (2019年7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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワJ-REITアクティブ・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	279,501,393	2.6099 729,482,847	3.0035 839,482,433	16.62
2	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	636,217,903	1.2839 816,843,502	1.3115 834,399,779	16.52
3	外国債券インデックスマザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	295,943,372	2.7010 799,345,326	2.8151 833,110,186	16.49
4	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	325,619,869	2.2070 718,646,717	2.5568 832,544,881	16.48
5	ダイワ好配当日本株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	324,104,822	2.5432 824,271,943	2.5581 829,092,545	16.41
6	ダイワ北米好配当株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	210,179,566	2.4819 521,648,136	2.8805 605,422,239	11.99
7	ダイワ欧州好配当株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	120,831,695	1.4950 180,647,094	1.5979 193,076,965	3.82
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当 株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	19,907,971	1.8059 35,953,343	1.9665 39,149,024	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

(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。

#### 八．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4計算期間末 (2010年1月12日)	569,366,003	569,366,003	0.8501	0.8501
第5計算期間末 (2011年1月11日)	749,069,355	749,069,355	0.8818	0.8818
第6計算期間末 (2012年1月10日)	860,992,412	860,992,412	0.8062	0.8062
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,272,367,641	1,272,367,641	1.0192	1.0192
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,919,665,131	1,919,665,131	1.3193	1.3193
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,724,473,332	2,724,473,332	1.5976	1.5976
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,855,754,201	2,855,754,201	1.5254	1.5254
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
2018年7月末日	4,134,899,513	-	1.7304	-
8月末日	4,255,845,859	-	1.7307	-

9月末日	4,367,108,668	-	1.7604	-
10月末日	4,311,161,510	-	1.6945	-
11月末日	4,423,580,406	-	1.7201	-
12月末日	4,222,486,036	-	1.6385	-
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
2019年1月末日	4,491,825,765	-	1.7031	-
2月末日	4,569,435,939	-	1.7314	-
3月末日	4,661,194,680	-	1.7551	-
4月末日	4,779,596,936	-	1.7646	-
5月末日	4,744,014,175	-	1.7245	-
6月末日	4,875,590,540	-	1.7528	-
7月末日	5,050,970,381	-	1.7825	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2019年1月11日～ 2019年7月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	20.0
第5計算期間	3.7
第6計算期間	8.6
第7計算期間	26.4
第8計算期間	29.4
第9計算期間	21.1
第10計算期間	4.5
第11計算期間	6.7

第12計算期間	7.9
第13計算期間	6.2
2019年1月11日～ 2019年7月10日	8.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	226,440,246	72,047,180
第5計算期間	242,895,054	63,170,502
第6計算期間	330,374,277	111,886,717
第7計算期間	315,959,783	135,527,444
第8計算期間	518,832,342	312,242,524
第9計算期間	501,213,562	250,896,906
第10計算期間	501,645,807	334,815,579
第11計算期間	489,108,988	304,974,316
第12計算期間	577,484,738	415,195,786
第13計算期間	682,462,389	295,483,585
2019年1月11日～ 2019年7月10日	372,182,471	180,848,633

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

#### ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

2019年7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	17,825円
純資産総額	50億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	1.0%
6カ月間	4.7%
1年間	3.0%
3年間	15.4%
5年間	27.3%
設定来	78.3%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	08年1月	09年1月	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

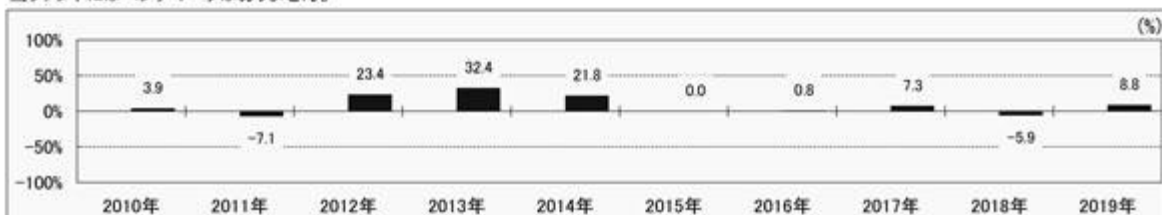
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国リート等	136	18.8%	日本円	50.9%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	0.4%	
国内リート	49	16.4%	米ドル	27.7%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.4%	
国内債券	269	16.4%	ユーロ	10.6%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.4%	
外国債券	774	16.2%	英ポンド	3.1%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.3%	
国内株式	164	15.7%	豪ドル	2.5%	債券格付別構成	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	0.3%	
外国株式	148	12.8%	カナダドル	1.2%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.5%
			香港ドル	1.2%	AA	6.7%	野村不動産マスターF	日本	1.2%
			シンガポール・ドル	1.1%	A	6.6%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.8%	BBB	0.3%	日本プロジスリート	日本	0.9%
コール・ローン、その他		3.8%	その他	1.0%	BB以下・無格付	2.0%	LINK REIT	香港	0.8%
合計	1,540	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.1%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。  
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンド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。  
・2019年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】

## (1) 【投資状況】 (2019年7月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	5,467,493,755	99.12
内 日本	5,467,493,755	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	48,708,274	0.88
純資産総額	5,516,202,029	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】 (2019年7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	ダイワ好配当日本株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	531,287,566	2.5434 1,351,318,213	2.5581 1,359,086,722	24.64
2	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	366,256,848	2.6145 957,605,127	3.0035 1,100,052,442	19.94
3	ダイワ・グローバルREIT・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	426,820,606	2.2133 944,699,806	2.5568 1,091,294,925	19.78
4	ダイワ北米好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	343,926,521	2.4878 855,642,891	2.8805 990,680,343	17.96
5	ダイワ欧州好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	198,007,246	1.4970 296,432,179	1.5979 316,395,778	5.74
6	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	208,502,701	1.2845 267,823,127	1.3115 273,451,292	4.96
7	外国債券インデックスマザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	96,968,490	2.7037 262,176,636	2.8151 272,975,996	4.95
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配 当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	32,319,480	1.8061 58,372,865	1.9665 63,556,257	1.15

(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。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

(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。

## 八．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4計算期間末 (2010年1月12日)	388,190,289	388,190,289	0.7761	0.7761
第5計算期間末 (2011年1月11日)	539,491,762	539,491,762	0.8234	0.8234
第6計算期間末 (2012年1月10日)	636,326,055	636,326,055	0.7304	0.7304
第7計算期間末 (2013年1月10日)	997,507,134	997,507,134	0.9581	0.9581
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,528,562,866	1,528,562,866	1.3144	1.3144
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,263,159,704	2,263,159,704	1.6365	1.6365
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,808,604,084	2,808,604,084	1.5507	1.5507
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809



2018年7月末日	4,402,989,624	-	1.8441	-
8月末日	4,496,073,526	-	1.8456	-
9月末日	4,639,473,016	-	1.8871	-
10月末日	4,486,659,842	-	1.7921	-
11月末日	4,615,708,871	-	1.8228	-
12月末日	4,343,125,414	-	1.7023	-
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
2019年1月末日	4,690,916,465	-	1.7935	-
2月末日	4,819,366,848	-	1.8299	-
3月末日	4,953,041,347	-	1.8543	-
4月末日	5,060,050,911	-	1.8727	-
5月末日	5,128,364,814	-	1.8110	-
6月末日	5,311,878,457	-	1.8472	-
7月末日	5,516,202,029	-	1.8872	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2019年1月11日～ 2019年7月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	24.7
第5計算期間	6.1
第6計算期間	11.3
第7計算期間	31.2
第8計算期間	37.2
第9計算期間	24.5

第10計算期間	5.2
第11計算期間	9.2
第12計算期間	11.1
第13計算期間	8.5
2019年1月11日～ 2019年7月10日	9.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	171,000,489	37,632,547
第5計算期間	201,894,087	46,877,227
第6計算期間	304,734,938	88,735,227
第7計算期間	263,861,578	93,971,400
第8計算期間	359,002,036	237,170,149
第9計算期間	458,619,078	238,638,593
第10計算期間	698,613,794	270,347,551
第11計算期間	433,420,891	252,225,036
第12計算期間	541,348,837	363,638,097
第13計算期間	676,061,653	274,586,229
2019年1月11日～ 2019年7月10日	502,619,504	185,734,307

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

## ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

#### ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

#### ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

(参考情報)運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

2019年7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	18,872円
純資産総額	55億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	2.2%
3か月間	0.8%
6か月間	5.2%
1年間	2.3%
3年間	20.2%
5年間	33.7%
設定来	88.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	08年1月	09年1月	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

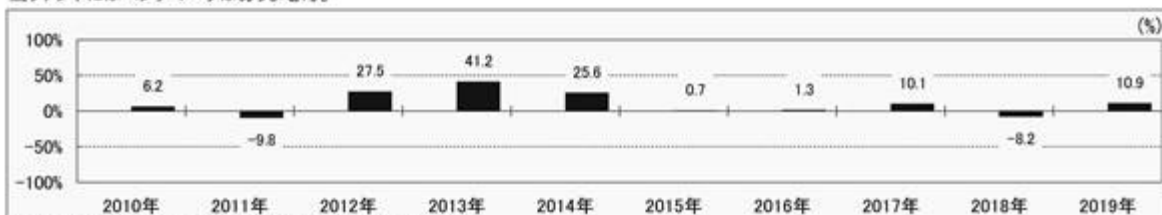
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	164	23.6%	日本円	51.0%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	0.6%	
外国リート等	136	23.4%	米ドル	29.6%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.6%	
国内リート	49	19.7%	ユーロ	7.5%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.6%	
外国株式	148	19.2%	英ポンド	3.1%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.5%	
国内債券	269	4.9%	豪ドル	2.7%	債券格付別構成	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	0.5%	
外国債券	774	4.9%	香港ドル	1.5%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.9%
			シンガポール・ドル	1.3%	AA	6.7%	野村不動産マスターF	日本	1.4%
			カナダ・ドル	1.3%	A	6.6%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.0%
			スイス・フラン	1.1%	BBB	0.3%	日本プロロジリート	日本	1.0%
コール・ローン、その他		4.4%	その他	0.7%	BB以下・無格付	2.0%	LINK REIT	香港	1.0%
合計	1,540	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.1%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンド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。

・2019年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

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、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。

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ないます。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ないます。

### 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。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。一部解約の実行の請求の受付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の実行の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の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、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の実行の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5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に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

・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

・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・公社債等：原則として次の1.～3.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

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

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】

無期限とします。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。

## (4) 【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10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。

## (5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、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、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付しま

す。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、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.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
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4.に該当する場合を除き、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

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 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5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前 の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の3.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### 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）を毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知られた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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

償還金にかかる請求権

受益者は、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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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。

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、

受益者が、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】

#### 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成30年1月11日から平成31年1月10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】

## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	43,508,359	50,946,537
親投資信託受益証券	3,162,650,641	3,565,147,273
流動資産合計	3,206,159,000	3,616,093,810
資産合計	3,206,159,000	3,616,093,810
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	627,312	1,621,480
未払受託者報酬	810,206	960,415
未払委託者報酬	13,774,371	16,327,565
その他未払費用	121,444	145,104
流動負債合計	15,333,333	19,054,564
負債合計	15,333,333	19,054,564
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,945,585,227	1 2,288,972,489
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,245,240,440	1,308,066,757
（分配準備積立金）	618,302,324	553,024,537
元本等合計	3,190,825,667	3,597,039,246
純資産合計	3,190,825,667	3,597,039,246
負債純資産合計	3,206,159,000	3,616,093,810

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自	平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		6
有価証券売買等損益		186,267,271		112,997,368
<b>営業収益合計</b>		<b>186,267,271</b>		<b>112,997,362</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		18,980		26,413
受託者報酬		1,548,416		1,822,149
委託者報酬		1 26,324,445		1 30,977,668
その他費用		232,200		278,041
<b>営業費用合計</b>		<b>28,124,041</b>		<b>33,104,271</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>158,143,230</b>		<b>146,101,633</b>
経常利益又は経常損失（ ）		158,143,230		146,101,633
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>158,143,230</b>		<b>146,101,633</b>
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（ ）		5,920,690		6,869,978
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>988,568,179</b>		<b>1,245,240,440</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		265,723,087		350,010,460
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>265,723,087</b>		<b>350,010,460</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		161,273,366		147,952,488
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>161,273,366</b>		<b>147,952,488</b>
分配金		2 -		2 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,245,240,440</b>		<b>1,308,066,757</b>

## (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13期	
	自 平成30年1月11日	至 平成31年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首元本額	1,777,104,491円	1,945,585,227円
期中追加設定元本額	458,208,043円	575,990,631円
期中一部解約元本額	289,727,307円	232,603,369円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,945,585,227口	2,288,972,489口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	自 平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	3,414,059円	4,071,543円

2. 2 分配金の計算過程	<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（152,232,091円）、投資信託約款に規定される収益調整金（746,426,943円）及び分配準備積立金（466,070,233円）より分配可能額は1,364,729,267円（1万口当たり7,014.49円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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（1,052,570,548円）及び分配準備積立金（553,024,537円）より分配可能額は1,605,595,085円（1万口当たり7,014.48円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
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13期 平成31年1月10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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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）
親投資信託受益証券	177,931,591	110,645,825
合計	177,931,591	110,645,825

## （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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6400円 (16,400円)	1.5715円 (15,715円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	外国債券インデックスマザーファンド	328,126,532	882,725,996	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	709,974,615	910,045,461	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	238,786,268	520,673,457	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	139,429,198	354,289,592	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	103,673,048	255,398,553	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	55,581,567	82,488,603	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	8,805,453	15,766,163	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	209,009,628	543,759,448	
親投資信託受益証券 合計			3,565,147,273	
合計			3,565,147,273	

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、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	253,833,153	230,509,218
コール・ローン	997,401,089	1,205,691,831
国債証券	165,477,927,881	162,968,622,856
派生商品評価勘定	316,558	3,416,203
未収入金	560,156	-
未収利息	1,367,216,562	1,312,237,478
前払費用	29,622,691	36,746,058
流動資産合計	168,126,878,090	165,757,223,644
資産合計	168,126,878,090	165,757,223,644
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,705,839	12,406,259
未払金	41,639,160	135,423,318
未払解約金	155,315,937	50,222,913
その他未払費用	-	22,676
流動負債合計	199,660,936	198,075,166
負債合計	199,660,936	198,075,166

純資産の部		
元本等		
元本	1	59,579,655,477
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		108,347,561,677
元本等合計		167,927,217,154
純資産合計		167,927,217,154
負債純資産合計		168,126,878,090
		61,542,450,975
		104,016,697,503
		165,559,148,478
		165,559,148,478
		165,757,223,644

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	58,821,711,450円	59,579,655,477円
期中追加設定元本額	6,422,343,811円	6,343,591,932円
期中一部解約元本額	5,664,399,784円	4,380,796,434円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	921,783,087円	690,564,508円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	31,459,334円	24,922,245円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	229,461,217円	160,549,057円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	64,088,823円	47,279,215円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	738,203,200円	524,647,964円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	2,265,111円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	282,044,594円	364,027,868円

ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	601,059,363円	1,133,977,935円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	422,454,374円	700,379,471円
D-I's 外国債券インデッ クス	914,939円	701,020円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	25,292円	27,109円
iFree 外国債券イン デックス	604,718,864円	512,803,907円
iFree 8資産バランス	258,986,457円	496,933,707円
iFree 年金バランス	- 円	4,558,433円
DCダイワ外国債券インデッ クス	40,176,085,790円	42,686,055,745円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	635,774,751円	735,766,293円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	305,402,028円	367,685,013円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	196,077,908円	233,087,436円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	276,894,361円	328,126,532円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	223,954,007円	261,594,952円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	69,820,116円	82,438,806円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,106,857円	10,434,826円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	17,688,877円	17,776,818円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,364,031円	1,838,407円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	- 円	3,640,463円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	448,932,063円	223,220,528円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	167,554,679円	149,818,145円

ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,350,815,507円	5,560,870,986円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	333,725,557円	15,278,574円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	129,188,409円	7,772,191円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	349,320,791円	325,032,492円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	129,282,889円	144,218,648円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	21,466,051円	28,863,937円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	374,472円	27,703,290円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,467,881,075円	5,556,510,701円
ダイワライフスタイル25	34,718,201円	35,109,364円
ダイワライフスタイル50	60,356,673円	58,680,101円
ダイワライフスタイル75	16,670,840円	17,289,177円
計	59,579,655,477円	61,542,450,975円
2. 期末日における受益権の総数	59,579,655,477口	61,542,450,975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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成31年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,292,936,102	2,144,596,306
合計	1,292,936,102	2,144,596,306

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年12月1日から平成30年1月10日まで、及び平成30年12月1日から平成31年1月10日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成30年1月10日 現在				平成31年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	627,444,801	-	625,055,520	2,389,281	1,102,187,666	-	1,093,197,610	8,990,056
アメリカ・ドル	263,125,788	-	262,379,520	746,268	381,194,717	-	376,240,600	4,954,117
イギリス・ ポンド	41,682,720	-	41,672,660	10,060	67,018,499	-	66,655,780	362,719
オーストラリ ア・ドル	19,105,488	-	19,043,920	61,568	19,413,731	-	19,365,000	48,731
カナダ・ドル	25,594,988	-	25,675,650	80,662	53,692,487	-	54,010,310	317,823
シンガポー ル・ドル	-	-	-	-	12,352,041	-	12,213,990	138,051
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	34,139,728	-	33,982,200	157,528
ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	4,051,392	-	4,083,200	31,808
ポーランド・ ズロチ	-	-	-	-	27,780,426	-	27,646,530	133,896
メキシコ・ ペソ	11,440,000	-	11,620,000	180,000	-	-	-	-
ユーロ	248,402,817	-	246,543,770	1,859,047	502,544,645	-	499,000,000	3,544,645
南アフリカ・ ランド	18,093,000	-	18,120,000	27,000	-	-	-	-
合計	627,444,801	-	625,055,520	2,389,281	1,102,187,666	-	1,093,197,610	8,990,056

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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



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

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8185円 (28,185円)	2.6902円 (26,902円)

附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	4,280,000.000	4,325,796.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,108,155.120	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,854,313.940	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,511,615.220	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,163,878.560	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,584,469.120	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,506,658.140	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,121,544.670	

2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,173,608.880	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,396,541.400	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,462,717.490	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,061,301.760	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,894,000.000	1,867,199.900	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,348,706.440	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,256,518.500	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,938,401.280	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,139,375.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,530,535.550	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,423,329.430	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,419,655.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,108,347.470	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,801,811.430	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,556,214.560	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,977,893.060	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,866,734.350	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,310,739.550	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,066,088.580	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,474,614.450	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	1,998,698.160	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,273,917.110	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,632,456.990	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,713,677.520	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,802,691.710	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	3,912,000.000	3,896,704.080	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,391,378.570	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,697,303.600	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,451,230.350	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	703,362.360	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,418,361.920	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	757,920.600	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,040,620.500	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	800,635.500	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	898,707.130	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	862,582.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	896,898.780	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	943,175.950	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,289,417.480	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	991,000.000	1,255,269.970	

4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,626,000.000	1,999,215.780	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	716,225.390	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	669,754.640	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	644,691.420	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,363,058.680	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,350,188.450	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,318,534.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,480,640.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,710,000.000	2,162,466.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,811,126.420	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,823,795.120	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,772,554.160	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,262,239.040	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,677,339.300	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,540,855.060	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,482,393.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,659,387.660	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,352,783.520	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,655,666.880	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,512,360.100	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,371,240.700	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,798,000.000	3,704,531.220	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,388,814.640	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,041,194.310	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,003,838.150	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	3,889,548.630	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,813,623.540	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,105,114.760	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,329,000.000	3,396,611.990	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,282,694.930	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,585,886.250	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,131,398.570	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,809,507.570	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,686,464.320	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,833,561.380	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,131,352.280	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,182,973.840	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,908,627.640	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,353,801.680	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,545,555.660	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,405,515.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,749,441.960	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,766,307.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,750,120.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,821,182.350	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,621,131.960	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	3,825,987.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,565,835.470	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,546,491.040	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,765,043.180	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,967,322.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,959,016.010	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,782,408.720	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,088,445.250	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,139,146.090	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,524,478.850	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,476,671.920	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,388,447.150	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,811,529.080	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,401,894.080	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,816,898.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,698,555.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,050,003.120	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	3,697,687.550	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,495,840.600	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,041,820.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,160,757.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	2,996,868.120	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,436,337.520	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,051,257.340	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,012,595.240	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,482,351.690	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,091,884.600	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,210,226.350	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,086,490.840	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,919,445.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,033,090.950	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,029,000.000	4,685,569.590	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,386,055.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	1,991,712.600	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,084,978.750	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,626,992.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,403,700.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,416,775.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,851,170.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,153,288.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	2,971,572.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,565,875.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,570,204.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,623,819.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,276,232.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,373,287.100	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,930,754.060	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,240,895.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,895,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,395,100.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,255,228.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,440,200.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,347,296.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	1,970,000.000	



2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,463,850.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115	1,500,000.000	1,481,655.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,173,926.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	2,951,425.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,442,973.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,531,422.650	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,130,000.000	2,102,033.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	2,950,251.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,251,125.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315	1,900,000.000	1,878,910.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	2,550,000.000	2,494,614.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,840,840.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415	850,000.000	838,338.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,569,926.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,482,220.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	2,936,250.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,914,920.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	4,000,000.000	3,941,080.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,923,110.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	1,942,340.000	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,657,907.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,921,700.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,329,296.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,967,420.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,698,102.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,277,497.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,834,286.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,929,200.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,594,230.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,098,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,926,700.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,450,475.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,441,000.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,316,054.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	983,320.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,450,175.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,302,330.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	2,930,709.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,434,900.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,545,568.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,974,280.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,119,232.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231	1,000,000.000	993,240.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,275,820.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,274,194.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20200131	2,300,000.000	2,285,878.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,476,725.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,318,207.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,800,000.000	1,793,250.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,483,475.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,309,768.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,584,946.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,721,924.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,576,636.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,188,096.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,500,000.000	1,493,130.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,894,084.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,902,030.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,490,125.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	3,969,771.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	5,500,000.000	5,568,750.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,004,800.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,200,000.000	1,196,196.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,520,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,928,785.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,397,802.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	1,927,892.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,521,275.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,009,950.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,507,600.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,294,687.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,023,190.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,305,775.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,300,891.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,520,875.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,000,000.000	6,075,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,174,716.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,512,200.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,538,475.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,500,675.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,631,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,627,252.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,518,445.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,308,349.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,558,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,041,940.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,025,890.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,558,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,316,368.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,056,560.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,035,760.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,500,000.000	4,653,945.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,300,000.000	3,526,611.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,507,700.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,046,620.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	3,000,000.000	3,045,000.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,806,888.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 694,018,365.100 (75,085,846,920)	
イギリス・ボ ンド		イギリス・ボ ンド	イギリス・ボ ンド

2% United Kingdom Gilt 20200722	2,280,000.000	2,324,026.800	
2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,941,568.410	
1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,515,294.420	
2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	2,016,259.000	
1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,513,681.950	
0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,287,195.000	
1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,210,000.000	1,138,852.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,100,000.000	1,112,210.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,330,000.000	1,359,659.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,127,660.700	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	1,988,500.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,200,000.000	1,242,084.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	924,885.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	200,000.000	200,562.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	70,000.000	69,825.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,293,770.040	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,372,794.930	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,795,734.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,826,163.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,834,640.000	

4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,219,448.100	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,803,217.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,913,164.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,223,078.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,557,284.960	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,457,361.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,480,000.000	2,032,632.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,432,687.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,799,722.400	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,521,872.220	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,620,000.000	2,281,932.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,330,029.200	
3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,883,816.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,306,362.500	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	866,597.600	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,055,716.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,318,071.060	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,550,491.800	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,064,229.480	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,623,426.400	

	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,531,269.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	2,885,029.200	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 78,542,806.870 (10,871,109,899)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,420,000.000	2,635,017.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,409,000.000	2,486,738.430	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,449,135.220	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,372,823.200	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,075,240.090	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,565,069.790	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,496,775.680	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,398,000.000	2,558,929.780	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,688,564.360	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,241,622.080	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,292,504.640	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	569,816.570	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,189,183.250	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	772,576.960	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,522,000.000	2,612,590.240	



	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,064,867.040	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,132,000.000	1,168,654.160	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,808,820.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	2,903,824.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	750,000.000	760,665.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,500,000.000	1,558,590.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	600,000.000	608,298.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	289,257.600	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 44,169,563.090 (3,427,558,096)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 425,000.000	カナダ・ドル 500,063.500	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	564,907.140	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,325,663.970	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,637,440.840	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,592,628.640	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,799,255.410	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,917,440.840	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	986,027.960	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,799,152.500	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	1,976,163.560	

1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,231,648.880	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,446,602.050	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,348,540.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,177,894.640	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,719,000.000	1,711,917.720	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,797,327.910	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,094,554.210	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,237,000.000	1,207,336.740	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,436,488.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,148,562.400	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	804,048.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,355,186.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,202,340.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,589,632.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,600,000.000	1,589,776.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501	700,000.000	698,845.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	602,430.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	300,000.000	287,793.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	299,322.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	600,000.000	614,208.000	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,203,740.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	600,000.000	609,630.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	302,094.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 39,858,661.110 (3,261,634,238)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	710,957.040	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	845,648.800	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,001.800	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	652,904.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	376,770.500	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	498,861.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	406,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	506,741.460	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	468,000.000	518,235.120	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	131,312.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	531,336.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,336.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	576,730.160	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	249,000.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	451,950.000	

	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	198,860.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	150,000.000	143,610.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	198,300.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	309,138.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,987,492.380 (638,679,891)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,095,000.000	10,023,963.300	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	5,934,960.450	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,532,351.850	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,552,647.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,860,269.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	5,994,672.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,684,270.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	2,900,000.000	2,939,266.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 52,522,400.850 (641,298,515)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	20,136,675.280	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,308,246.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,263,434.440	

	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	8,363,000.000	9,390,561.810	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	6,900,000.000	7,092,579.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,523,190.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 51,714,687.030 (865,703,861)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,431,176.200	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,360,848.560	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,424,197.050	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,446,773.750	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,323,433.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,471,873.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,400,000.000	2,452,512.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 29,910,814.160 (381,961,097)	
ポーランド・ズ ロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,619,306.510	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	2,478,000.000	2,485,434.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,333,943.250	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,148,057.300	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,061,373.400	

	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,370,000.000	2,324,282.700	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,348,536.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,150,000.000	2,186,550.000	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	293,850.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	1,000,000.000	1,010,100.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,039,646.510	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,407,603.200	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,201,559.800	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,407,561.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,400,000.000	2,382,840.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,704,978.090	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,955,622.010 (986,750,376)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	547,203.540	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	797,778.000	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,197,684.380	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,941,329.520	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,544,264.860	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,282,866.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	865,926.250	

3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	719,004.290	
4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	599,750.460	
3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	1,044,000.000	1,043,979.120	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	988,937.950	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	927,000.000	865,150.560	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	569,978.760	
3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	659,712.960	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	614,820.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,069,493.740	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	866,589.830	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	733,712.980	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	701,470.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,163,542.590	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	794,252.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	701,094.420	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	915,994.200	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	641,329.000	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	352,323.840	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	502,990.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	754,102.500	

	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	872,912.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,075,084.500	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,192,920.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	500,115.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	717,871.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	400,000.000	415,180.000	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 28,209,364.250 (743,598,842)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,290,000.000	11,276,166.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	6,347,530.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,680,300.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	15,633,000.000	15,327,218.520	
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	23,608,935.840	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	24,168,000.000	22,517,567.280	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,790,151.760	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	8,708,156.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	9,358,975.360	
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,816,324.800	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	26,640,612.400	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	12,008,680.200	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	23,163,156.370	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	16,573,332.840	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,308,901.760	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 220,126,009.590 (1,239,309,434)	
ユーロ	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	438,458.400	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	415,403.460	



0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	293,109.030	
0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	419,877.600	
Finland Government Bond 20230915	200,000.000	201,594.000	
1.375% Finland Government Bond 20470415	200,000.000	210,992.000	
Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,962.800	
0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	302,883.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	382,080.500	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	498,815.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	935,978.220	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,164,903.300	
1.5% Austria Government Bond 20470220	734,000.000	762,875.560	
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	141,697.500	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	907,983.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	585,452.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	340,000.000	395,542.400	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,552.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,023,840.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,446,887.770	
1% Belgium Government Bond 20310622	924,000.000	919,010.400	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	598,298.760	

1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,334,910.180	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	918,276.000	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	452,711.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	495,414.500	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,421,196.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	662,369.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	494,914.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	300,276.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,140,000.000	1,144,947.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	554,796.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,294,611.580	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,116,621.790	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,036,857.380	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,790,437.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,569,986.880	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,332,626.640	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	2,899,959.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,273,401.890	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,065,644.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,539,996.420	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,155,468.500	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,032,150.560	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	2,275,310.620	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,513,138.720	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,479,185.780	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,834,720.740	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,521,634.400	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,022,521.460	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,397,471.340	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,038,000.000	2,838,281.840	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,763,831.160	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,522,489.800	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,968,555.970	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,774,937.970	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,726,044.530	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,405,531.030	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,746,115.420	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,650,140.460	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,285,972.480	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,294,519.480	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,257,169.840	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,854,645.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,628,224.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,381,581.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,000,000.000	1,102,520.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,547,430.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,200,000.000	1,204,572.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313	700,000.000	705,019.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	807,112.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	353,608.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	707,966.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,744,415.250	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,470,212.320	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,599,397.680	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,421,728.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	360,000.000	366,134.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,137,107.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	500,000.000	508,565.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	900,000.000	914,499.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,353,340.750	

6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,199,970.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,464,971.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,534,652.360	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,209,000.000	3,405,504.850	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,195,030.640	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,542,631.700	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	3,869,376.640	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,953,395.910	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	4,926,998.400	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,380,000.000	3,556,030.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	1,922,200.710	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,876,375.360	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,282,191.550	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,575,707.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,030,534.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	3,812,440.240	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,949,445.080	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,238,000.000	3,072,057.840	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,626,541.440	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,455,795.380	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,787,000.000	3,287,322.240	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,727,887.240	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,356,819.480	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	3,070,000.000	3,092,380.300	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,732,038.380	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,224,228.320	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,920,000.000	4,174,878.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,737,000.000	2,768,639.720	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,264,189.720	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	887,000.000	854,979.300	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,798,503.300	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,762,452.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	2,000,000.000	2,020,160.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,120,000.000	1,197,224.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225	700,000.000	704,361.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,601,950.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,442,510.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,414,688.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,139,196.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,423,256.000	

1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	950,000.000	964,877.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,100,000.000	2,108,883.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,600,000.000	1,598,064.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	722,510.600	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,820,797.230	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,107,445.050	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	923,816.810	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,218,094.860	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,512,648.390	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,604,428.210	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,575,343.380	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,463,760.960	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,514,082.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	1,823,352.650	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,693,484.700	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,386,723.240	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,312,482.240	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,376,427.360	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,217,628.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,249,944.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	807,568.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,191,802.500	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,469,730.220	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,477,765.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,098,381.520	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,848,611.120	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,352,977.200	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,631,459.790	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,610,005.320	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,498,767.400	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,511,000.000	1,517,603.070	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	1,847,488.090	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,503,142.720	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	775,942.740	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,240,848.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,294,127.500	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,286,000.000	1,215,244.280	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,661,193.900	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	799,814.400	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,435,394.240	



0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	665,105.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,333,800.440	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	540,386.640	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,095,312.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	1,944,976.500	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,287,728.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,246,975.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	969,883.600	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,396,538.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,300,000.000	1,239,628.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,669,434.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,153,800.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,890,500.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	800,000.000	741,416.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,419,690.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	874,962.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,238,471.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	500,000.000	492,020.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,250,000.000	1,242,475.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	400,000.000	410,532.000	

2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	600,000.000	603,000.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	200,000.000	206,352.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	2,966,910.540	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,678,343.900	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,108,734.800	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,005,696.890	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	2,997,000.480	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,017,357.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,922,755.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,441,349.180	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,546,218.650	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,447,730.240	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,444,858.100	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,673,612.800	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,340,707.220	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,347,090.200	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,280,680.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,498,493.350	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,241,307.640	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,892,989.940	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,184,982.700	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,811,819.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,112,188.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,413,000.000	1,660,642.380	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,457,411.640	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,843,062.130	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,385,377.770	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,027,613.120	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,640,678.490	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,437,191.600	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,630,550.000	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	1,000,341.280	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,864,151.520	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,521,110.960	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,630,321.620	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,293,161.870	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,538,496.120	
4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	925,099.200	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,481,112.480	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	753,000.000	1,091,503.620	

2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,710,026.150	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	743,724.690	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,476,022.860	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	838,485.900	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	587,054.160	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	707,755.930	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	862,700.040	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	532,026.960	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	820,831.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,104,664.230	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	350,000.000	356,482.000	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,144.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	500,310.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	690,214.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	202,498.000	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	735,000.000	781,334.400	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,233,069.750	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,332,102.720	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,481,476.220	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	1,930,453.580	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,166,112.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	902,443.100	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	998,352.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	557,170.980	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	884,211.440	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,048,417.160	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	748,534.770	

1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,022,487.880	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	837,145.030	
3.375% Finland Government Bond 20200415	632,000.000	663,587.360	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	500,608.350	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	471,919.240	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	656,204.760	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	479,115.500	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	543,377.560	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	587,285.220	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,333,607.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,830,679.500	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,097,841.680	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	1,934,016.000	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,686,613.500	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,840,497.990	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,785,643.640	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,528,622.040	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	850,000.000	949,254.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,749,479.800	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,380,000.000	1,395,262.800	

1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,830,744.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,506,129.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,068,101.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,305,187.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,010,700.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,096,451.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	850,042.500	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	700,000.000	698,369.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	900,000.000	892,971.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	200,000.000	200,262.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	2,896,978.940	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,148,099.420	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,308,000.000	1,861,689.480	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,037,507.520	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	2,608,901.700	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,218,950.140	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,713,725.190	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,835,282.180	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,840,969.150	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,645,263.350	

	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,329,332.360	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,147,751.680	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,601,000.000	1,899,218.270	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,358,100.200	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,231,261.500	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,295,306.100	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,339,455.140	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,934,789.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 510,907,643.030 (63,863,455,379)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,837,792.800	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	17,934,000.000	19,628,763.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,400,701.400	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,595,423.500	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,300,737.520	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,474,119.450	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	5,539,000.000	5,490,256.800	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	17,652,000.000	15,929,164.800	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,920,002.100	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,825,972.920	

	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,776,593.440	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	8,243,000.000	7,497,997.660	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,791,107.200	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,179,000.000	4,828,329.910	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 123,296,962.500 (961,716,308)	
国債証券	合計		162,968,622,856 [162,968,622,856]	
合計			162,968,622,856 [162,968,622,856]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 245銘柄	100%	46.0%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.7%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 33銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 297銘柄	100%	39.2%
南アフリカ・ランド	国債証券 14銘柄	100%	0.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。



## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	119,981,661	25,896,593
国債証券	12,248,930,100	14,084,673,690
地方債証券	1,126,771,800	936,314,000
特殊債券	918,536,600	918,622,200
社債券	1,022,211,800	1,043,178,800
未収入金	100,287,000	86,746,610
未収利息	33,053,698	32,947,023
前払費用	577,365	318,250
流動資産合計	15,570,350,024	17,128,697,166
資産合計	15,570,350,024	17,128,697,166
負債の部		
流動負債		
未払金	124,388,480	-
未払解約金	14,489,000	23,618,648
その他未払費用	-	3,279
流動負債合計	138,877,480	23,621,927
負債合計	138,877,480	23,621,927
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,192,600,488	13,344,778,620
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,238,872,056	3,760,296,619
元本等合計	15,431,472,544	17,105,075,239
純資産合計	15,431,472,544	17,105,075,239
負債純資産合計	15,570,350,024	17,128,697,166

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	12,100,057,670円	12,192,600,488円
期中追加設定元本額	2,656,707,757円	2,484,162,074円
期中一部解約元本額	2,564,164,939円	1,331,983,942円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	- 円	13,050,515円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	57,003円	59,366円
iFree 日本債券イン デックス	95,701,236円	115,479,282円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	579,958,533円	1,077,056,677円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	5,194,468,127円	5,829,421,442円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,730,610,699円	3,175,753,849円
	878,298,725円	1,003,199,495円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	619,619,430円	709,974,615円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	501,025,738円	565,614,868円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	156,231,097円	178,625,800円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	62,145,381円	56,096,348円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,818,436円	48,034,174円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,664,105円	5,068,294円
ダイワつみたてインデックス日本債券	- 円	14,157,915円
ダイワ世界バランスファンド40VA	717,968,308円	341,397,807円
ダイワ世界バランスファンド60VA	225,429,930円	192,516,134円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	187,097,803円	8,170,599円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	193,505,937円	11,101,440円
計	12,192,600,488円	13,344,778,620円
2. 期末日における受益権の総数	12,192,600,488口	13,344,778,620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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、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	平成31年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	46,163,920	109,901,630
地方債証券	3,151,500	1,568,200
特殊債券	1,805,700	745,400
社債券	1,910,400	1,329,500
合計	53,031,520	113,544,730

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年12月1日から平成30年1月10日まで、及び平成30年12月1日から平成31年1月10日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2656円 (12,656円)	1.2818円 (12,818円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 8 6 2年国債	170,000,000	170,498,100	
	3 8 9 2年国債	50,000,000	50,177,000	
	3 9 5 2年国債	20,000,000	20,094,600	
	1 2 3 5年国債	100,000,000	100,297,000	
	1 2 4 5年国債	120,000,000	120,440,400	
	1 2 5 5年国債	370,000,000	371,598,400	
	1 2 6 5年国債	233,000,000	234,155,680	
	1 2 7 5年国債	30,000,000	30,167,700	
	1 2 8 5年国債	167,000,000	168,042,080	
	1 2 9 5年国債	132,000,000	132,908,160	
	1 3 0 5年国債	197,000,000	198,483,410	
	1 3 1 5年国債	90,000,000	90,734,400	
	1 3 2 5年国債	40,000,000	40,352,400	
	1 3 3 5年国債	150,000,000	151,419,000	
	1 3 4 5年国債	60,000,000	60,606,000	
	1 3 5 5年国債	170,000,000	171,825,800	
	1 3 6 5年国債	65,000,000	65,740,350	
	1 3 7 5年国債	130,000,000	131,534,000	
	1 4 0年国債	30,000,000	43,465,800	
	2 4 0年国債	23,000,000	32,322,360	
	3 4 0年国債	19,000,000	26,845,100	
	4 4 0年国債	30,000,000	42,603,900	
	5 4 0年国債	35,000,000	47,898,200	
	6 4 0年国債	28,000,000	37,631,720	
	7 4 0年国債	31,000,000	39,864,450	
	8 4 0年国債	23,000,000	27,489,600	

9	40年国債	40,000,000	35,012,800	
10	40年国債	91,000,000	94,073,980	
11	40年国債	40,000,000	39,940,400	
306	10年国債	10,000,000	10,184,200	
308	10年国債	100,000,000	102,097,000	
309	10年国債	103,000,000	104,863,270	
310	10年国債	30,000,000	30,584,400	
311	10年国債	42,000,000	42,675,780	
312	10年国債	94,000,000	96,468,440	
313	10年国債	34,000,000	35,081,200	
314	10年国債	77,000,000	79,110,570	
315	10年国債	90,000,000	92,961,900	
316	10年国債	56,000,000	57,705,760	
317	10年国債	40,000,000	41,344,800	
318	10年国債	33,000,000	34,020,360	
319	10年国債	140,000,000	145,166,000	
320	10年国債	35,000,000	36,188,250	
321	10年国債	65,000,000	67,392,650	
322	10年国債	140,000,000	144,705,400	
323	10年国債	70,000,000	72,539,600	
324	10年国債	80,000,000	82,626,400	
325	10年国債	160,000,000	165,640,000	
326	10年国債	20,000,000	20,673,600	
327	10年国債	90,000,000	93,387,600	
328	10年国債	60,000,000	61,895,400	
329	10年国債	160,000,000	166,790,400	
330	10年国債	81,000,000	84,634,470	
331	10年国債	130,000,000	134,604,600	
332	10年国債	65,000,000	67,425,800	
333	10年国債	63,000,000	65,469,600	
334	10年国債	181,000,000	188,442,720	
335	10年国債	160,000,000	165,968,000	
337	10年国債	50,000,000	51,333,000	
338	10年国債	52,000,000	53,769,040	
339	10年国債	25,000,000	25,885,250	
340	10年国債	133,000,000	137,895,730	
341	10年国債	15,000,000	15,467,850	
342	10年国債	75,000,000	76,334,250	
343	10年国債	192,000,000	195,388,800	

3 4 4	1 0 年国債	38,000,000	38,648,660	
3 4 5	1 0 年国債	150,000,000	152,461,500	
3 4 6	1 0 年国債	43,000,000	43,673,380	
3 4 7	1 0 年国債	155,000,000	157,303,300	
3 4 8	1 0 年国債	150,000,000	152,029,500	
3 4 9	1 0 年国債	170,000,000	172,135,200	
3 5 0	1 0 年国債	185,000,000	187,127,500	
3 5 1	1 0 年国債	100,000,000	101,039,000	
3 5 2	1 0 年国債	130,000,000	131,196,000	
2	3 0 年国債	9,000,000	11,305,440	
3	3 0 年国債	4,000,000	4,993,480	
4	3 0 年国債	8,000,000	10,612,480	
5	3 0 年国債	8,000,000	10,007,280	
6	3 0 年国債	9,000,000	11,547,090	
7	3 0 年国債	12,000,000	15,327,360	
1 0	3 0 年国債	15,000,000	16,804,350	
1 1	3 0 年国債	9,000,000	10,848,780	
1 2	3 0 年国債	11,000,000	13,913,130	
1 3	3 0 年国債	11,000,000	13,772,330	
1 4	3 0 年国債	22,000,000	28,899,200	
1 5	3 0 年国債	21,000,000	27,981,870	
1 6	3 0 年国債	26,000,000	34,701,420	
1 7	3 0 年国債	17,000,000	22,481,990	
1 8	3 0 年国債	20,000,000	26,194,800	
1 9	3 0 年国債	15,000,000	19,684,200	
2 0	3 0 年国債	16,000,000	21,543,360	
2 1	3 0 年国債	16,000,000	21,056,640	
2 2	3 0 年国債	17,000,000	22,980,940	
2 3	3 0 年国債	16,000,000	21,671,520	
2 4	3 0 年国債	15,000,000	20,355,450	
2 5	3 0 年国債	17,000,000	22,519,560	
2 6	3 0 年国債	32,000,000	43,032,320	
2 7	3 0 年国債	32,000,000	43,724,160	
2 8	3 0 年国債	34,000,000	46,639,500	
2 9	3 0 年国債	43,000,000	58,377,660	
3 0	3 0 年国債	56,000,000	75,241,040	
3 1	3 0 年国債	38,000,000	50,491,360	
3 2	3 0 年国債	49,000,000	66,341,100	
3 3	3 0 年国債	65,000,000	84,326,450	

3 4	3 0 年国債	50,000,000	67,109,000	
3 5	3 0 年国債	68,000,000	88,695,120	
3 6	3 0 年国債	59,000,000	77,147,220	
3 7	3 0 年国債	67,000,000	86,319,450	
3 8	3 0 年国債	39,000,000	49,459,020	
3 9	3 0 年国債	37,000,000	47,811,770	
4 0	3 0 年国債	44,000,000	55,955,680	
4 1	3 0 年国債	34,000,000	42,481,980	
4 2	3 0 年国債	33,000,000	41,258,250	
4 3	3 0 年国債	37,000,000	46,288,850	
4 4	3 0 年国債	42,000,000	52,635,240	
4 5	3 0 年国債	43,000,000	51,861,010	
4 6	3 0 年国債	55,000,000	66,352,000	
4 7	3 0 年国債	44,000,000	54,163,560	
4 8	3 0 年国債	45,000,000	53,220,600	
4 9	3 0 年国債	45,000,000	53,225,100	
5 0	3 0 年国債	44,000,000	45,472,240	
5 1	3 0 年国債	45,000,000	40,856,850	
5 2	3 0 年国債	47,000,000	44,976,180	
5 3	3 0 年国債	55,000,000	53,966,550	
5 4	3 0 年国債	45,000,000	46,386,900	
5 5	3 0 年国債	46,000,000	47,371,720	
5 6	3 0 年国債	50,000,000	51,440,000	
5 7	3 0 年国債	50,000,000	51,388,500	
5 8	3 0 年国債	55,000,000	56,469,600	
5 9	3 0 年国債	45,000,000	45,000,000	
6 0	3 0 年国債	31,000,000	32,603,940	
4 4	2 0 年国債	32,000,000	33,011,520	
4 5	2 0 年国債	20,000,000	20,608,400	
4 6	2 0 年国債	19,000,000	19,647,330	
4 7	2 0 年国債	23,000,000	23,919,310	
4 8	2 0 年国債	9,000,000	9,464,580	
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,197,880	
5 0	2 0 年国債	30,000,000	31,352,100	
5 1	2 0 年国債	25,000,000	26,313,500	
5 2	2 0 年国債	19,000,000	20,153,110	
5 3	2 0 年国債	13,000,000	13,861,510	
5 4	2 0 年国債	14,000,000	14,969,220	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	43,817,520	



5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,889,440	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	25,695,840	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	37,655,450	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,219,300	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	41,928,800	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,675,360	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	32,606,400	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	38,379,950	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	46,273,080	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	32,903,100	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	21,030,340	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	28,063,500	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,407,720	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	20,511,000	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	19,185,180	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	59,826,930	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,956,920	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	28,182,500	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	19,253,010	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,946,420	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	74,393,800	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	32,235,840	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	36,027,580	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	7,060,200	
8 7	2 0 年国債	20,000,000	23,388,800	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	39,008,310	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,618,400	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	52,923,150	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	21,093,840	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	53,105,400	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	36,035,100	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	27,236,600	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	29,909,500	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	40,380,100	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	63,175,470	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	42,170,100	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	22,019,040	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,276,700	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,582,830	

104	20年国債	64,000,000	76,757,120	
105	20年国債	38,000,000	45,710,580	
106	20年国債	16,000,000	19,401,600	
107	20年国債	20,000,000	24,126,600	
108	20年国債	48,000,000	56,951,520	
109	20年国債	35,000,000	41,646,500	
110	20年国債	27,000,000	32,675,670	
111	20年国債	35,000,000	42,836,150	
112	20年国債	34,000,000	41,259,000	
113	20年国債	70,000,000	85,213,800	
114	20年国債	45,000,000	54,917,100	
115	20年国債	42,000,000	51,712,080	
116	20年国債	27,000,000	33,346,080	
117	20年国債	37,000,000	45,286,150	
118	20年国債	13,000,000	15,802,150	
119	20年国債	23,000,000	27,437,160	
120	20年国債	40,000,000	46,811,600	
123	20年国債	42,000,000	51,788,520	
124	20年国債	45,000,000	54,958,050	
125	20年国債	25,000,000	31,208,000	
126	20年国債	21,000,000	25,710,720	
127	20年国債	43,000,000	52,130,190	
128	20年国債	32,000,000	38,885,120	
129	20年国債	45,000,000	54,132,300	
130	20年国債	28,000,000	33,732,440	
131	20年国債	47,000,000	56,037,160	
132	20年国債	25,000,000	29,861,750	
133	20年国債	47,000,000	56,735,580	
134	20年国債	15,000,000	18,141,600	
135	20年国債	20,000,000	23,931,000	
136	20年国債	40,000,000	47,346,400	
137	20年国債	18,000,000	21,575,700	
139	20年国債	62,000,000	73,503,480	
141	20年国債	48,000,000	57,724,800	
142	20年国債	45,000,000	54,727,200	
143	20年国債	48,000,000	57,112,320	
144	20年国債	24,000,000	28,225,920	
145	20年国債	75,000,000	90,406,500	
146	20年国債	71,000,000	85,709,070	

	1 4 7	2 0 年国債	89,000,000	106,226,840	
	1 4 8	2 0 年国債	59,000,000	69,637,110	
	1 4 9	2 0 年国債	97,000,000	114,596,770	
	1 5 0	2 0 年国債	75,000,000	87,493,500	
	1 5 1	2 0 年国債	74,000,000	84,066,960	
	1 5 2	2 0 年国債	69,000,000	78,404,010	
	1 5 3	2 0 年国債	72,000,000	82,954,080	
	1 5 4	2 0 年国債	87,000,000	98,816,340	
	1 5 5	2 0 年国債	68,000,000	75,008,080	
	1 5 6	2 0 年国債	53,000,000	53,127,730	
	1 5 7	2 0 年国債	93,000,000	89,893,800	
	1 5 8	2 0 年国債	63,000,000	63,987,840	
	1 5 9	2 0 年国債	82,000,000	84,532,160	
	1 6 0	2 0 年国債	66,000,000	69,121,800	
	1 6 1	2 0 年国債	69,000,000	70,943,040	
	1 6 2	2 0 年国債	60,000,000	61,604,400	
	1 6 3	2 0 年国債	72,000,000	73,820,160	
	1 6 4	2 0 年国債	90,000,000	90,474,300	
	1 6 5	2 0 年国債	60,000,000	60,159,600	
	1 6 6	2 0 年国債	50,000,000	51,932,000	
国債証券 合計				14,084,673,690	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	102,368,700	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	103,184,100	
	1 1	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	117,377,600	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	100,293,800	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	103,013,000	
	2 9 - 6	千葉県公債	100,000,000	100,919,400	
	1 1 6	共同発行地方	100,000,000	103,051,200	
	1 1 7	共同発行地方	100,000,000	102,789,700	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	103,316,500	
地方債証券 合計				936,314,000	
特殊債券	9 8	政保道路機構	100,000,000	101,466,000	
	1 2 2	政保道路機構	100,000,000	101,858,400	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	102,969,800	
	2 4 1	政保道路機構	100,000,000	103,170,700	
	2 6 1	政保道路機構	100,000,000	102,983,500	
	3 6	地方公共団体	100,000,000	102,906,600	
	1 4	政保地方公共 6	100,000,000	100,415,500	
	6 5	地方公共団体	100,000,000	102,863,000	

	い 7 8 9 利付商工債	100,000,000	99,988,700	
特殊債券	合計		918,622,200	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,883,800	
	3 3 中日本高速道	100,000,000	102,802,800	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	102,650,200	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,453,500	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	100,580,500	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	101,267,300	
	8 0 三菱地所	100,000,000	116,719,500	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	111,328,400	
	7 0 東日本旅客鉄道	100,000,000	102,023,900	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	104,468,900	
社債券	合計		1,043,178,800	
合計			16,982,788,690	

## 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。

## 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,841,382,473	2,544,587,759
コール・ローン	586,142,203	459,739,031
投資証券	107,663,766,778	85,452,798,470
派生商品評価勘定	22,294	1,027,640
未収入金	1,300,410,624	640,139,392
未収配当金	497,655,945	375,219,862
流動資産合計	113,889,380,317	89,473,512,154
資産合計	113,889,380,317	89,473,512,154
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	-	35,981
未払金	1,230,869,594	509,998,361
未払解約金	154,300,000	90,000,000
その他未払費用	-	10,865
流動負債合計	1,385,169,594	600,045,207
負債合計	1,385,169,594	600,045,207
純資産の部		
元本等		
元本	1	49,411,771,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	63,092,439,163	48,114,575,441
元本等合計	112,504,210,723	88,873,466,947
純資産合計	112,504,210,723	88,873,466,947
負債純資産合計	113,889,380,317	89,473,512,154

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	60,612,975,202円	49,411,771,560円
期中追加設定元本額	351,050,998円	241,325,768円
期中一部解約元本額	11,552,254,640円	8,894,205,822円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREI	44,834,560,648円	36,671,794,648円
T・オープン（毎月分配型）		
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	39,191,006円	32,937,857円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	21,809,358円	17,940,110円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,940,781円	16,895,462円

成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	107,031,757円	84,706,741円
6資産バランスファンド(分配型)	178,981,256円	153,611,646円
6資産バランスファンド(成長型)	391,872,890円	345,054,843円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,908,901,201円	1,595,047,787円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	57,412,853円	46,338,729円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	5,211,062円	4,310,926円
常陽3分法ファンド	278,623,546円	221,126,129円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	64,952,916円	52,169,101円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	205,819,486円	238,786,268円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	278,170,544円	317,016,351円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	346,790,767円	393,487,604円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	64,953,728円	50,327,337円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	542,272,184円	457,522,556円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)	28,180,219円	26,695,146円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	37,095,358円	33,122,265円
計	49,411,771,560円	40,758,891,506円
2. 期末日における受益権の総数	49,411,771,560口	40,758,891,506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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成31年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)



## 売買目的有価証券

種 類	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	2,043,090,434	4,182,635,453
合計	2,043,090,434	4,182,635,453

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年9月16日から平成30年1月10日まで、及び平成30年9月19日から平成31年1月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成30年1月10日 現在				平成31年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	209,572,113	-	209,555,996	16,117	293,648,445	-	292,620,805	1,027,640
アメリカ・ドル	100,977,233	-	100,968,253	8,980	217,384,000	-	216,360,000	1,024,000
イギリス・ ポンド	108,594,880	-	108,587,743	7,137	50,385,062	-	50,381,422	3,640
ユーロ	-	-	-	-	25,879,383	-	25,879,383	0
買 建	209,572,113	-	209,578,290	6,177	76,264,445	-	76,228,464	35,981
アメリカ・ドル	108,594,880	-	108,598,486	3,606	76,264,445	-	76,228,464	35,981
ユーロ	100,977,233	-	100,979,804	2,571	-	-	-	-
合計	419,144,226	-	419,134,286	22,294	369,912,890	-	368,849,269	991,659

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額	2,2769円	2,1805円
(1万口当たり純資産額)	(22,769円)	(21,805円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	274,673	8,361,046.120	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	46,601	8,081,545.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	100,673	11,823,037.120	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	224,808	9,927,521.280	
		VORNADO REALTY TRUST	124,986	8,012,852.460	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	36,248	5,978,745.120	
		EQUITY RESIDENTIAL	130,264	8,639,108.480	
		EQUINIX INC	22,209	7,935,719.880	
		AMERICAN TOWER CORP	37,250	5,948,080.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	7,442,075.040	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	279,169	8,221,527.050	

	RLJ LODGING TRUST	338,620	5,990,187.800	
	CYRUSONE INC	192,285	9,670,012.650	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	174,847	5,957,037.290	
	PARK HOTELS & RESORTS INC	229,171	6,455,747.070	
	INVITATION HOMES INC	672,253	13,485,395.180	
	VICI PROPERTIES INC	511,663	10,166,743.810	
	LIFE STORAGE INC	86,581	7,943,806.750	
	VENTAS INC	66,372	3,864,177.840	
	CROWN CASTLE INTL CORP	55,901	5,907,058.670	
	IRON MOUNTAIN INC	190,759	6,565,924.780	
	VEREIT INC	1,360,196	10,201,470.000	
	SUN COMMUNITIES INC	171,068	17,212,862.160	
	PROLOGIS INC	391,667	24,013,103.770	
	COUSINS PROPERTIES INC	502,571	4,201,493.560	
	SITE CENTERS CORP	442,920	5,456,774.400	
	DUKE REALTY CORP	369,171	9,827,332.020	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	87,045	21,331,247.700	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	49,308	6,013,603.680	
	WELLTOWER INC	341,535	23,798,158.800	
	HCP INC	416,371	11,870,737.210	
	KILROY REALTY CORP	187,141	12,253,992.680	
	MACERICH CO/THE	88,066	4,091,546.360	
	REALTY INCOME CORP	99,663	6,272,789.220	
	REGENCY CENTERS CORP	161,293	9,485,641.330	
	UDR INC	650,299	25,433,193.890	
	CUBESMART	223,093	6,329,148.410	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	395,567	5,466,735.940	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	134,176	13,663,142.080	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	135,761	12,016,206.110	
	DOUGLAS EMMETT INC	174,170	6,015,831.800	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 401,332,360.930 (43,420,148,129)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	14,484,145	7,937,311.460	
	SEGRO PLC	2,543,075	15,665,342.000	
	UNITE GROUP PLC	339,396	2,859,411.300	
	BRITISH LAND CO PLC	2,592,295	14,076,161.850	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,128,858	6,214,363.290	
	BIG YELLOW GROUP PLC	651,403	5,843,084.910	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,098,902	7,246,858.730	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 59,842,533.540 (8,282,805,068)	
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	12,579,703	21,951,581.730	
	SCENTRE GROUP	2,860,758	11,443,032.000	
	GPT GROUP	7,733,315	41,527,901.550	
	GOODMAN GROUP	1,845,608	20,283,231.920	
	CHARTER HALL GROUP	2,934,087	21,682,902.930	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,011,756	17,614,445.080	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 134,503,095.210 (10,437,440,188)
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	397,407	15,335,936.130	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	403,368	17,990,212.800	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,326,148.930 (2,727,078,768)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	15,119,513	20,864,927.940	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,931,700	5,119,005.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,252,477	16,756,638.360	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3,027,100	5,902,845.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 48,643,416.300 (3,889,527,567)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	652,915	8,128,791.750	
	GECINA SA	117,678	13,815,397.200	
	KLEPIERRE	483,942	13,550,376.000	
	COVIVIO	200,241	16,940,388.600	
	AEDIFICA	51,699	4,104,900.600	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	37,259	4,254,977.800	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	1,751,060	14,743,925.200	

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	892,119	9,724,097.100	
ユーロ	小計		ユーロ 85,262,854.250 (10,657,856,781)	
香港・ドル	FORTUNE REIT	12,880,070	香港・ドル 120,943,857.300	
	LINK REIT	3,962,305	316,588,169.500	
香港・ドル	小計		香港・ドル 437,532,026.800 (6,037,941,969)	
投資証券	合計		85,452,798,470 [85,452,798,470]	
合計			85,452,798,470 [85,452,798,470]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 41銘柄	100%	50.7%
イギリス・ポンド	投資証券 7銘柄	100%	9.7%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	12.2%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.2%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	4.6%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	12.5%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	7.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,566,106,650	336,338,173
投資証券	91,141,400,700	102,721,473,160
未収入金	292,206,702	591,772,740
未収配当金	901,684,906	1,022,947,360
流動資産合計	93,901,398,958	104,672,531,433
資産合計	93,901,398,958	104,672,531,433
負債の部		
流動負債		
未払金	475,270,969	351,319,798
未払解約金	8,015,000	63,797,000
その他未払費用	-	7,878
流動負債合計	483,285,969	415,124,676
負債合計	483,285,969	415,124,676
純資産の部		
元本等		
元本	1 39,732,652,426	40,074,865,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	53,685,460,563	64,182,541,234
元本等合計	93,418,112,989	104,257,406,757
純資産合計	93,418,112,989	104,257,406,757
負債純資産合計	93,901,398,958	104,672,531,433

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2. 収益及び費用の計上基準	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	32,116,023,773円	39,732,652,426円
期中追加設定元本額	8,781,778,931円	3,894,385,063円
期中一部解約元本額	1,165,150,278円	3,552,171,966円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	21,568,970円	16,324,252円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,794,359円	14,928,918円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	105,046,049円	75,145,191円
6 資産バランスファンド（分配型）	176,275,746円	138,161,686円
6 資産バランスファンド（成長型）	384,869,180円	310,377,097円
世界 6 資産均等分散ファンド（毎月分配型）	56,815,849円	42,981,217円
『しがぎん』S R I 三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	2,504,007円	1,772,953円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	63,882,040円	45,346,969円
成果リレー（ブラジル国債 & J - R E I T ） 2014-07	26,550,226円	- 円

成果リレー(ブラジル国債 & J-REIT)2014-08	34,247,124円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	203,190,399円	209,009,628円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	273,256,940円	277,551,866円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	341,178,374円	354,113,582円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	374,692,962円	354,050,748円
ダイワファンドラップ J-REITセレクト	36,585,392,646円	37,250,828,134円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)	135,752,895円	98,597,464円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)	44,042,591円	33,674,499円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	222,451,499円	162,026,929円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	661,140,570円	689,974,390円
計	39,732,652,426円	40,074,865,523円
2. 期末日における受益権の総数	39,732,652,426口	40,074,865,523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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、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	平成31年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	4,194,928,471	229,401,786
合計	4,194,928,471	229,401,786

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年11月11日から平成30年1月10日まで、及び平成30年11月13日から平成31年1月10日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3512円 (23,512円)	2,6016円 (26,016円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,667	891,845,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	16,955	1,500,517,500	
	森ヒルズリート	22,201	3,077,058,600	
	産業ファンド	9,639	1,104,629,400	
	アドバンス・レジデンス	9,965	3,089,150,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	11,163	1,885,430,700	
	A P I 投資法人	5,240	2,297,740,000	
	G L P 投資法人	18,573	2,046,744,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	3,452	974,844,800	
	日本プロロジスリート	19,281	4,504,041,600	
	星野リゾート・リート	4,123	2,164,575,000	
	O N E リート投資法人	2,907	792,157,500	
	イオンリート投資	6,054	770,674,200	
	ヒューリックリート投資法	15,524	2,634,422,800	
	日本リート投資法人	6,151	2,269,719,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	33,556	527,164,760	
	日本ヘルスケア投資法	432	72,576,000	
	積水ハウス・リート投資	42,998	3,091,556,200	
	ケネディクス商業リート	8,173	2,062,047,900	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,801	206,754,800	
	野村不動産マスターF	43,847	6,541,972,400	
	ラサールロジポート投資	10,475	1,105,112,500	
	三井不ロジパーク	4,708	1,466,542,000	
大江戸温泉リート	9,453	754,349,400		
投資法人みらい	2,729	516,053,900		
森トラスト・ホテルリート投	5,064	658,826,400		

三菱地所物流REIT	2,329	568,043,100	
CREロジスティクスファンド	5,361	539,852,700	
ザイマックス・リート	9,071	1,025,930,100	
日本ビルファンド	7,309	5,123,609,000	
ジャパンリアルエステイト	16,289	10,229,492,000	
日本リテールファンド	20,628	4,544,348,400	
オリックス不動産投資	27,744	5,165,932,800	
日本プライムリアルティ	3,892	1,654,100,000	
プレミアム投資法人	12,042	1,526,925,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,552	313,896,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,867	2,894,377,200	
森トラスト総合リート	12,844	2,087,150,000	
インヴィンシブル投資法人	39,462	1,842,875,400	
フロンティア不動産投資	5,264	2,263,520,000	
福岡リート投資法人	6,712	1,128,287,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	5,012	3,533,460,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,298	125,646,400	
大和証券オフィス投資法人	2,580	1,816,320,000	
阪急阪神リート投資法人	1,353	196,185,000	
スターツプロシード投資法人	4,455	754,231,500	
大和ハウスリート投資法人	15,544	3,833,150,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,498	2,109,096,600	
日本賃貸住宅投資法人	16,590	1,380,288,000	
ジャパンエクセレント投資法人	6,999	1,058,248,800	
投資証券 合計		102,721,473,160	
合計		102,721,473,160	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 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。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	27,804,918	60,237,003
コール・ローン	37,659,761	81,824,449
株式	1,648,368,256	1,552,015,502
ハイブリッド優先証券	445,118,172	453,582,465
投資証券	47,240,853	42,682,171
未収入金	18,561,407	17,571,381
未収配当金	2,629,155	2,564,780
未収利息	1,263,227	1,446,368
流動資産合計	2,228,645,749	2,211,924,119
資産合計	2,228,645,749	2,211,924,119
負債の部		
流動負債		
未払金	22,053,263	18,997,392
未払解約金	-	1,255,000
その他未払費用	-	2,153
流動負債合計	22,053,263	20,254,545
負債合計	22,053,263	20,254,545
純資産の部		
元本等		
元本	1 835,469,909	889,650,063
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,371,122,577	1,302,019,511
元本等合計	2,206,592,486	2,191,669,574
純資産合計	2,206,592,486	2,191,669,574
負債純資産合計	2,228,645,749	2,211,924,119

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

### (2)ハイブリッド優先証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

### (3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### 為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	924,678,641円	835,469,909円
期中追加設定元本額	80,179,676円	136,219,368円
期中一部解約元本額	169,388,408円	82,039,214円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,748,365円	10,836,111円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,555,045円	10,024,161円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	219,784,094円	179,086,701円
ダイワ・株/債券/コモディ	37,006,944円	31,733,446円
ティ・バランスファンド		
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	37,918,398円	31,395,290円

米国好配当株オープン（予想 分配金提示型）	441,935円	- 円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽ノ安定コース）	83,379,457円	103,673,048円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽ノ6分散コー ス）	169,080,922円	206,831,439円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽ノ成長コース）	263,554,749円	316,069,867円
計	835,469,909円	889,650,063円
2. 期末日における受益権の総数	835,469,909口	889,650,063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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
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	平成31年1月10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	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	113,759,916	55,962,359
ハイブリッド優先証券	2,271,245	2,757,675
投資証券	251,501	399,894
合計	111,740,172	53,604,578

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年10月17日から平成30年1月10日まで、及び平成30年10月16日から平成31年1月10日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6411円 (26,411円)	2.4635円 (24,635円)

## 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	
アメリカ・ドル	PALO ALTO NETWORKS INC	株 680	アメリカ・ドル 193.110	アメリカ・ドル 131,314.800	



ABBOTT LABORATORIES	1,521	69.440	105,618.240	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,235	156.790	193,635.650	
DOLLAR TREE INC	3,204	97.170	311,332.680	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,656	72.440	192,400.640	
TE CONNECTIVITY LTD	3,624	77.070	279,301.680	
APPLE INC	1,947	153.310	298,494.570	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,546	57.050	202,299.300	
JPMORGAN CHASE & CO	3,036	100.400	304,814.400	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,221	113.100	138,095.100	
MORGAN STANLEY	4,888	41.740	204,025.120	
TELEFLEX INC	277	259.620	71,914.740	
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,401	61.300	208,481.300	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,323	129.690	171,579.870	
AMAZON.COM INC	211	1,659.420	350,137.620	
EOG RESOURCES INC	1,785	99.190	177,054.150	
NEXTERA ENERGY INC	802	172.790	138,577.580	
ALPHABET INC-CL A	470	1,081.650	508,375.500	
HOME DEPOT INC	964	179.730	173,259.720	
HERSHEY CO/THE	1,937	105.690	204,721.530	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,720	79.940	217,436.800	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,789	120.690	215,914.410	
JOHNSON & JOHNSON	2,671	128.930	344,372.030	
FACEBOOK INC-CLASS A	3,367	144.230	485,622.410	
DXC TECHNOLOGY CO	5,281	59.190	312,582.390	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,087	116.160	126,265.920	
MERCK & CO. INC.	1,799	75.410	135,662.590	
NORTHROP GRUMMAN CORP	500	252.150	126,075.000	
APTIV PLC	3,215	69.540	223,571.100	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,575	67.910	174,868.250	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	4,730	65.780	311,139.400	
XCEL ENERGY INC	2,077	48.460	100,651.420	
PEPSICO INC	1,864	107.490	200,361.360	
ACCENTURE PLC-CL A	929	145.870	135,513.230	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,110	14.700	178,017.000	
SCHLUMBERGER LTD	4,269	41.240	176,053.560	
AT&T INC	11,104	30.100	334,230.400	

	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,725	97.920	266,832.000	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,583	124.310	196,782.730	
	ANTHEM INC	1,065	251.350	267,687.750	
	WALT DISNEY CO/THE	1,373	112.670	154,695.910	
	WASTE MANAGEMENT INC	1,495	91.870	137,345.650	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,596	151.660	242,049.360	
	VISA INC-CLASS A SHARES	3,082	138.410	426,579.620	
	PPL CORP	3,520	29.290	103,100.800	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,211	120.810	267,110.910	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	310	236.390	73,280.900	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	3,337	61.000	203,557.000	
	BANK OF AMERICA CORP	14,688	25.760	378,362.880	
	AMERICAN EXPRESS CO	2,028	98.830	200,427.240	
	ANALOG DEVICES INC	1,570	87.400	137,218.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,018	104.360	314,958.480	
	EATON CORP PLC	3,945	69.060	272,441.700	
	ECOLAB INC	917	148.710	136,367.070	
	SNAP-ON INC	1,789	157.760	282,232.640	
	MICROSOFT CORP	5,310	104.270	553,673.700	
	CVS HEALTH CORP	5,124	66.040	338,388.960	
	MEDTRONIC PLC	2,121	84.300	178,800.300	
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,986	35.440	141,263.840	
	CHUBB LTD	1,304	127.960	166,859.840	
	STARBUCKS CORP	1,592	63.880	101,696.960	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 13,705,485.700 (1,482,796,498)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	7,310	40.560	296,493.600	
	ROYAL BANK OF CANADA	3,009	95.740	288,081.660	
	ENBRIDGE INC	5,718	45.700	261,312.600	
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 845,887.860 (69,219,004)	
合計				1,552,015,502 [1,552,015,502]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	6,057.000	156,815.730	
		CHS INC 7.5 4	3,125.000	81,968.750	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4,200.000	109,494.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,100.000	28,127.000	
		SCE TRUST IV 5.375 J	442.000	8,840.000	
		SOUTHERN CO 6.25	4,040.000	104,514.800	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	3,775.000	96,828.750	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	1,854.000	45,775.260	
		BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	2,536.000	65,378.080	
		CITIGROUP INC 6.3 S	7,300.000	187,610.000	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	3,725.000	89,772.500	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	1,948.000	50,297.360	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	2,675.000	65,163.000	
		SCE TRUST V 5.45 K	2,034.000	42,754.680	
		KKR & CO INC 6.75 A	1,143.000	29,900.880	
		BANK OF AMERICA CORP 6 EE	3,056.000	78,203.040	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.25 K	850.000	20,655.000	
		STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	723.000	18,205.140	
		DOMINION ENERGY INC 5.25 A	1,275.000	30,064.500	
		LEGG MASON INC 5.45	1,325.000	29,693.250	
		ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	28,740.000	
		SOUTHERN CO 5.25	796.000	18,228.400	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	25,908.000	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	1,476.000	36,678.600	
		NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	1,975.000	47,459.250	
SCE TRUST VI 5	2,402.000	43,908.560			
VALLEY NATIONAL BANCORP FR B	1,101.000	24,915.630			
TCF FINANCIAL CO 5.7 C	400.000	9,240.000			

SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	45,063.780	
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.7	9,000.000	214,110.000	
ENBRIDGE INC FR B	6,380.000	160,712.200	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	4,775.000	122,144.500	
UNUM GROUP 6.25	2,300.000	57,316.000	
KKR & CO INC 6.5 B	750.000	19,522.500	
NISOURCE INC 6.5 B	1,550.000	39,261.500	
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	4,450.000	114,632.000	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	2,000.000	50,560.000	
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	53,025.000	
WELLS FARGO & COMPANY 6 T	7,000.000	178,150.000	
CITIGROUP CAPITAL XIII FR	2,275.000	60,287.500	
PARTNERRE LTD 6.5 G	1,851.000	47,515.170	
MORGAN STANLEY 6.875 F	4,099.000	108,828.450	
ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	6,484.000	165,990.400	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	1,900.000	48,564.000	
US BANCORP 6.5 F	1,000.000	26,960.000	
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	2,722.000	72,677.400	
BB&T CORPORATION 5.85	3,676.000	91,936.760	
MORGAN STANLEY 6.625 G	1,171.000	29,860.500	
BB&T CORPORATION 5.625 E	3,197.000	77,814.980	
MORGAN STANLEY 6.375 I	2,933.000	75,466.090	
NUSTAR LOGISTICS LP FR	6,175.000	152,769.500	
REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	3,043.000	78,387.680	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 B	4,800.000	119,808.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.25 C	2,000.000	50,560.000	
STATE STREET CORP 5.25 C	1,650.000	38,973.000	
STATE STREET CORP 5.9 D	1,925.000	49,029.750	
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	863.000	21,505.960	
JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	2,282.000	58,921.240	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	1,150.000	29,463.000	

		HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875	1,400.000	38,486.000	
		PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B	4,850.000	119,019.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 4,192,462.020 (453,582,465)	
ハイブリッド優先証券 合計				453,582,465 [453,582,465]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	793	20,443.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1,750	39,830.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	1,975	45,346.000	
		COLONY CAPITAL INC 8.75 E	2,150	52,589.000	
		GLOBAL NET LEASE INC 7.25 A	1,100	25,938.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIA 6 A	2,550	59,797.500	
		VORNADO REALTY TRUST 5.25 M	425	9,184.250	
		PS BUSINESS PARKS INC 5.2 Y	825	17,745.750	
		QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	28,811.000	
		KIMCO REALTY CORP 5.625 K	875	20,545.000	
		NATIONAL RETAIL PROP INC 5.7 E	1,058	25,286.200	
		SITE CENTERS CORP 6.5 J	2,050	48,995.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 394,511.240 (42,682,171)	
投資証券 合計				42,682,171 [42,682,171]	
合計				496,264,636 [496,264,636]	

ハイブリッド優先証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 ハイブリッ ド優先証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額 に 対する比 率
アメリカ・ドル	株式 61銘柄	74.9%	22.9%	2.2%	96.6%
	ハイブリッ ド優先証券 61銘柄				
	投資証券 12銘柄				
カナダ・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	-%	3.4%

## 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。

## 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	51,759,627	55,778,969
コール・ローン	17,110,193	31,311,532
株式	1,290,119,399	1,058,521,362
未収配当金	2,186,318	2,026,765
流動資産合計	1,361,175,537	1,147,638,628
資産合計	1,361,175,537	1,147,638,628
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,000,000
その他未払費用	-	653
流動負債合計	-	1,000,653
負債合計	-	1,000,653
純資産の部		
元本等		

元本	1	779,893,882	772,639,327
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		581,281,655	373,998,648
元本等合計		1,361,175,537	1,146,637,975
純資産合計		1,361,175,537	1,146,637,975
負債純資産合計		1,361,175,537	1,147,638,628

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買取相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	904,864,619円	779,893,882円
期中追加設定元本額	61,832,903円	74,639,626円
期中一部解約元本額	186,803,640円	81,894,181円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,410,399円	17,639,183円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,420,342円	16,232,681円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	334,775,452円	297,130,387円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	57,165,219円	53,456,345円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	57,625,272円	51,202,245円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	47,580,807円	55,581,567円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	96,067,502円	110,309,660円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	149,848,889円	171,087,259円
計	779,893,882円	772,639,327円
2. 期末日における受益権の総数	779,893,882口	772,639,327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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
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	平成31年1月10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

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	16,274,379	13,840,281
合計	16,274,379	13,840,281

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年10月17日から平成30年1月10日まで、及び平成30年10月16日から平成31年1月10日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7453円 (17,453円)	1.4841円 (14,841円)

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	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	14.295	212,194.980	
	AVIVA PLC	40,669	3.925	159,625.820	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	15.370	244,383.000	
	VODAFONE GROUP PLC	96,642	1.528	147,668.970	
	KINGFISHER PLC	30,751	2.306	70,911.800	
	NATIONAL GRID PLC	10,672	7.898	84,287.450	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,047	24.970	126,023.590	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	6.461	280,433.240	
	CARNIVAL PLC	3,111	40.450	125,839.950	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	23.755	279,382.550		
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,730,751.350 (239,553,295)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,029	253.400	260,748.600	
	NESTLE SA-REG	5,858	81.660	478,364.280	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,034	299.200	309,372.800	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	85.100	373,503.900	
	GIVAUDAN-REG	138	2,321.000	320,298.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 1,742,287.580 (193,550,727)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	SWEDBANK AB - A SHARES	5,994	205.500	1,231,767.000	
	NORDEA BANK ABP	13,623	79.730	1,086,161.790	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 2,317,928.790 (28,301,911)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	98.640	276,192.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	72.950	218,558.200	
	BASF SE	3,218	63.330	203,795.940	
	ALLIANZ SE-REG	1,074	177.140	190,248.360	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	187.650	232,498.350	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	14.770	312,311.650	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,394	30.820	258,703.080	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	22.395	145,701.870	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,798	75.300	285,989.400	
	KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.491	219,031.130	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	7,197	21.490	154,663.530	
	TOTAL SA	6,299	47.830	301,281.170	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	60.160	281,308.160	
	BNP PARIBAS	3,990	40.775	162,692.250	
	CAPGEMINI SE	1,620	90.800	147,096.000	
	ALSTOM	4,147	34.890	144,688.830	
	SANOFI	3,682	74.130	272,946.660	
	INTESA SANPAOLO	68,243	2.006	136,929.570	
	ENI SPA	14,849	14.256	211,687.340	
	ENEL SPA	48,153	5.164	248,662.090	
	ENAGAS SA	10,115	24.590	248,727.850	
	NOKIA OYJ	23,125	5.328	123,210.000	

ユーロ 小計			ユーロ	
			4,776,923.430	
			(597,115,429)	
合計			1,058,521,362	
			[1,058,521,362]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における[ ]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	22.6%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	18.3%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	100%	2.7%
ユーロ	株式 22銘柄	100%	56.4%

## 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。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	30,062,823	35,915,540
コール・ローン	8,894,163	12,370,388
株式	908,055,613	644,045,508
投資証券	7,166,614	23,537,942
未収配当金	389,749	176,695

流動資産合計		954,568,962	716,046,073
資産合計		954,568,962	716,046,073
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,000,000	-
その他未払費用		-	200
流動負債合計		1,000,000	200
負債合計		1,000,000	200
純資産の部			
元本等			
元本	1	401,541,859	399,914,948
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		552,027,103	316,130,925
元本等合計		953,568,962	716,045,873
純資産合計		953,568,962	716,045,873
負債純資産合計		954,568,962	716,046,073

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	516,871,495円	401,541,859円
期中追加設定元本額	11,127,669円	30,191,058円
期中一部解約元本額	126,457,305円	31,817,969円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,509,082円	15,154,627円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,283,037円	12,486,286円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	247,861,560円	238,136,163円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	42,194,616円	41,793,124円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	43,012,578円	39,223,517円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	6,592,904円	8,805,453円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	13,310,198円	17,430,598円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	20,777,884円	26,885,180円
計	401,541,859円	399,914,948円
2. 期末日における受益権の総数	401,541,859口	399,914,948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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 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。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
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	平成31年1月10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

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在



種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	44,806,509	15,276,869
投資証券	0	2,120,342
合計	44,806,509	13,156,527

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年10月17日から平成30年1月10日まで、及び平成30年10月16日から平成31年1月10日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3748円 (23,748円)	1.7905円 (17,905円)

## 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	
アメリカ・ドル	NETEASE INC-ADR	株 400	アメリカ・ドル 258.440	アメリカ・ドル 103,376.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 103,376.000 (11,184,249)	
オーストラリア・ドル	BHP GROUP LTD	株 11,600	オーストラリア・ドル 34.300	オーストラリア・ドル 397,880.000	
	ALUMINA LTD	82,000	2.320	190,240.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,600	33.150	86,190.000	
	OZ MINERALS LTD	10,400	9.060	94,224.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,000	24.570	147,420.000	
	WESTPAC BANKING CORP	7,500	25.760	193,200.000	
	RIO TINTO LTD	1,900	80.020	152,038.000	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,900	72.330	282,087.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	41,000	6.110	250,510.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,000	113.980	227,960.000	
	CSL LTD	700	195.100	136,570.000	
	COCHLEAR LTD	600	183.260	109,956.000	
	SUNCORP GROUP LTD	7,900	12.290	97,091.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,129	6.930	132,563.970	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,497,929.970 (193,839,366)	
オフショア・人民元	株 CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	10,100	38.450	オフショア・人民元 388,345.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 388,345.000 (6,166,919)	
シンガポール・ドル	株 UNITED OVERSEAS BANK LTD	7,300	25.550	シンガポール・ドル 186,515.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,600	24.240	135,744.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	85,300	2.170	185,101.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 507,360.000 (40,568,506)	
韓国・ウォン	株 HYUNDAI MOTOR CO	1,100	123,000.000	韓国・ウォン 135,300,000.000	
	POSCO	270	255,500.000	68,985,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	500	209,000.000	104,500,000.000	
	S-OIL CORP	500	94,800.000	47,400,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	100	1,097,000.000	109,700,000.000	
	LG CHEM LTD	200	352,000.000	70,400,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,700	39,350.000	66,895,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	2,800	46,450.000	130,060,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,750	39,600.000	425,700,000.000	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,100	33,550.000	104,005,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	450	184,000.000	82,800,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	300	180,000.000	54,000,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン	

				1,399,745,000.000	
				(135,635,291)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	73,000	7.360	537,280.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	21,000	49.800	1,045,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	9,500	120.000	1,140,000.000	
	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	53,000	8.400	445,200.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	20,400	25.800	526,320.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,400	73.000	686,200.000	
	AIA GROUP LTD	42,200	65.900	2,780,980.000	
	HKBN LTD	54,500	11.780	642,010.000	
	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	48,000	9.330	447,840.000	
	CRRC CORP LTD - H	70,000	7.980	558,600.000	
	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	7,000	92.150	645,050.000	
	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	286,000	1.540	440,440.000	
	WYNN MACAU LTD	24,000	16.780	402,720.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 10,298,440.000 (142,118,473)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	TAIMED BIOLOGICS INC	7,000	175.000	1,225,000.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	92,000	45.950	4,227,400.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,335.000	3,335,000.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	94,000	72.900	6,852,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	56,000	215.500	12,068,000.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,000	29.300	4,922,400.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 32,630,400.000 (114,532,704)	
合計				644,045,508 [644,045,508]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資証券	オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	27,600	オーストラリア・ドル 303,324.000
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 303,324.000 (23,537,942)
投資証券 合計				23,537,942 [23,537,942]
合計				23,537,942 [23,537,942]

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	1.7%
オーストラリア・ドル	株式 14銘柄 投資証券 1銘柄	89.2%	10.8%	32.5%
オフショア・人民元	株式 1銘柄	100%	-%	0.9%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	6.1%
韓国・ウォン	株式 12銘柄	100%	-%	20.3%
香港・ドル	株式 13銘柄	100%	-%	21.3%
台湾・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	17.2%

## 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。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
--	--------------	--------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,031,183,861	1,421,764,635
株式	20,866,198,650	16,512,574,500
派生商品評価勘定	33,823,002	-
未収入金	799,255,774	17,911,974
未収配当金	24,915,000	40,665,000
差入委託証拠金	13,950,000	-
流動資産合計	22,769,326,287	17,992,916,109
資産合計	22,769,326,287	17,992,916,109
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,702	-
前受金	31,500,000	-
未払金	84,496,574	388,484,061
未払解約金	87,000,000	6,000,000
その他未払費用	-	28,792
流動負債合計	202,999,276	394,512,853
負債合計	202,999,276	394,512,853
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,857,276,545	6,925,910,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,709,050,466	10,672,492,654
元本等合計	22,566,327,011	17,598,403,256
純資産合計	22,566,327,011	17,598,403,256
負債純資産合計	22,769,326,287	17,992,916,109

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首	平成29年1月11日	平成30年1月11日
期首元本額	14,998,002,056円	6,857,276,545円
期中追加設定元本額	673,006,918円	1,066,341,766円
期中一部解約元本額	8,813,732,429円	997,707,709円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	5,402,825,531円	5,308,438,930円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	29,390,858円	29,355,376円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	33,177,542円	31,060,367円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	29,702,462円	28,563,870円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	549,192,051円	510,956,622円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	92,462,542円	90,789,419円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	94,658,375円	86,323,444円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	101,111,790円	139,429,198円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	204,795,806円	277,930,622円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	319,959,588円	423,062,754円
計	6,857,276,545円	6,925,910,602円
2. 期末日における受益権の総数	6,857,276,545口	6,925,910,602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 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
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	平成31年1月10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	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	2,343,583,088	1,893,018,091
合計	2,343,583,088	1,893,018,091

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年10月17日から平成30年1月10日まで、及び平成30年10月16日から平成31年1月10日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	平成30年1月10日 現在				平成31年1月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,007,575,000	-	1,041,425,000	33,850,000	-	-	-	-
合計	1,007,575,000	-	1,041,425,000	33,850,000	-	-	-	-

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。



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

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

(1口当たり情報)

	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,2909円 (32,909円)	2,5410円 (25,410円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
大林組	100,000	1,022.00	102,200,000	
熊谷組	30,000	3,410.00	102,300,000	
五洋建設	160,000	623.00	99,680,000	
大和ハウス	145,000	3,519.00	510,255,000	
ライト工業	50,000	1,440.00	72,000,000	
積水ハウス	65,000	1,635.00	106,275,000	
ディー・エヌ・エー	20,000	1,889.00	37,780,000	
ローソン	20,000	6,990.00	139,800,000	
エービーシー・マート	7,500	6,200.00	46,500,000	
双日	550,000	405.00	222,750,000	
日本たばこ産業	100,000	2,654.00	265,400,000	
アルコニックス	20,000	1,074.00	21,480,000	
ダイワボウHD	20,000	5,090.00	101,800,000	
三洋貿易	25,000	1,780.00	44,500,000	
セブン&アイ・HLDGS	27,500	4,926.00	135,465,000	
帝人	47,500	1,796.00	85,310,000	
東レ	100,000	784.10	78,410,000	
旭化成	105,000	1,134.00	119,070,000	
SUMCO	50,000	1,257.00	62,850,000	
マツオカコーポレーション	69,900	2,780.00	194,322,000	
王子ホールディングス	125,000	599.00	74,875,000	
昭和電工	47,500	3,595.00	170,762,500	
住友化学	300,000	550.00	165,000,000	

クレハ	15,000	6,380.00	95,700,000
デンカ	22,500	3,250.00	73,125,000
信越化学	15,000	8,575.00	128,625,000
日本触媒	9,500	7,060.00	67,070,000
カネカ	12,500	4,170.00	52,125,000
三菱瓦斯化学	20,000	1,679.00	33,580,000
三井化学	25,000	2,500.00	62,500,000
J S R	15,000	1,664.00	24,960,000
三菱ケミカルH L D G S	210,000	859.30	180,453,000
宇部興産	20,000	2,229.00	44,580,000
旭有機材	15,000	1,475.00	22,125,000
電通	45,000	4,800.00	216,000,000
花 王	15,000	7,373.00	110,595,000
三洋化成	5,000	5,070.00	25,350,000
武田薬品	80,000	4,200.00	336,000,000
アステラス製薬	95,000	1,503.50	142,832,500
塩野義製薬	11,000	6,383.00	70,213,000
小野薬品	34,000	2,333.00	79,322,000
沢井製薬	17,000	5,450.00	92,650,000
大塚ホールディングス	45,000	4,556.00	205,020,000
D I C	15,000	3,360.00	50,400,000
ヤフー	300,000	291.00	87,300,000
トレンドマイクロ	14,000	6,070.00	84,980,000
構造計画研究所	15,000	2,094.00	31,410,000
日本ハウズイング	8,200	3,075.00	25,215,000
ポーラ・オルビスHD	10,000	2,787.00	27,870,000
デクセリアルズ	30,000	827.00	24,810,000
昭和シェル石油	140,000	1,614.00	225,960,000
出光興産	25,000	3,775.00	94,375,000
J X T Gホールディングス	265,000	594.30	157,489,500
ブリヂストン	35,000	4,225.00	147,875,000
A G C	20,000	3,470.00	69,400,000
日本電気硝子	20,000	2,710.00	54,200,000
太平洋セメント	15,000	3,520.00	52,800,000
ノ ザ ワ	20,000	893.00	17,860,000
東海カーボン	90,000	1,471.00	132,390,000
フジインコーポレーテッド	15,000	2,182.00	32,730,000
J F Eホールディングス	20,000	1,797.50	35,950,000
大紀アルミニウム	90,000	573.00	51,570,000
日本軽金属HD	225,000	221.00	49,725,000

住友鉱山	10,000	3,035.00	30,350,000
住友電工	50,000	1,483.00	74,150,000
東 プ レ	15,000	2,272.00	34,080,000
タ ク マ	25,000	1,345.00	33,625,000
アイダエンジニア	40,000	731.00	29,240,000
D M G 森精機	45,000	1,268.00	57,060,000
豊田自動織機	10,000	5,290.00	52,900,000
小松製作所	42,500	2,536.50	107,801,250
荏原実業	20,000	1,790.00	35,800,000
三精テクノロジーズ	31,500	1,713.00	53,959,500
ダイフク	15,000	4,815.00	72,225,000
キトー	50,000	1,532.00	76,600,000
日本精工	70,000	978.00	68,460,000
三菱電機	75,000	1,240.50	93,037,500
日本電産	6,000	12,070.00	72,420,000
愛知電機	20,000	2,930.00	58,600,000
パナソニック	90,000	1,039.50	93,555,000
T D K	10,500	7,360.00	77,280,000
マクセルホールディングス	45,000	1,472.00	66,240,000
アドバンテスト	65,000	2,234.00	145,210,000
デンソー	40,000	5,077.00	203,080,000
ファナック	12,500	17,090.00	213,625,000
村田製作所	8,000	13,655.00	109,240,000
日産自動車	50,000	897.80	44,890,000
トヨタ自動車	60,000	6,704.00	402,240,000
三菱自動車工業	125,000	635.00	79,375,000
武蔵精密工業	20,000	1,517.00	30,340,000
アイシン精機	19,000	4,005.00	76,095,000
本田技研	85,000	3,095.00	263,075,000
S U B A R U	25,000	2,390.50	59,762,500
ヤマハ発動機	30,000	2,181.00	65,430,000
萩原電気H L D G S	17,500	2,742.00	47,985,000
キヤノン	45,000	3,026.00	136,170,000
バンダイナムコH L D G S	17,500	4,730.00	82,775,000
任 天 堂	8,500	29,795.00	253,257,500
伊 藤 忠	255,000	1,926.00	491,130,000
丸 紅	110,000	798.30	87,813,000
三井物産	190,000	1,739.50	330,505,000
東京エレクトロン	6,000	13,390.00	80,340,000
日立ハイテクノロジーズ	12,500	3,570.00	44,625,000

住友商事	210,000	1,602.00	336,420,000	
日本ユニシス	30,000	2,473.00	74,190,000	
三菱商事	190,000	3,088.00	586,720,000	
阪和興業	10,000	2,921.00	29,210,000	
ニプロ	60,000	1,364.00	81,840,000	
伊藤忠エネクス	60,000	987.00	59,220,000	
あおぞら銀行	27,500	3,305.00	90,887,500	
三菱UFJフィナンシャルG	825,000	561.80	463,485,000	
りそなホールディングス	225,000	545.70	122,782,500	
三井住友トラストHD	30,000	4,177.00	125,310,000	
三井住友フィナンシャルG	145,000	3,819.00	553,755,000	
セブン銀行	250,000	315.00	78,750,000	
みずほフィナンシャルG	1,300,000	173.30	225,290,000	
SBIホールディングス	60,000	2,204.00	132,240,000	
日立キャピタル	30,000	2,335.00	70,050,000	
オリックス	130,000	1,668.00	216,840,000	
SOMPOホールディングス	17,500	3,828.00	66,990,000	
MS&AD	55,000	3,180.00	174,900,000	
第一生命HLDGS	70,000	1,721.00	120,470,000	
東京海上HD	80,000	5,219.00	417,520,000	
T&Dホールディングス	40,000	1,330.50	53,220,000	
三井不動産	17,500	2,473.00	43,277,500	
東京建物	77,500	1,165.00	90,287,500	
サンフロンティア不動産	25,000	1,085.00	27,125,000	
西日本旅客鉄道	25,000	8,060.00	201,500,000	
SGホールディングス	25,000	3,030.00	75,750,000	
日本航空	30,000	3,900.00	117,000,000	
日本電信電話	80,000	4,593.00	367,440,000	
KDDI	85,000	2,688.50	228,522,500	
NTTドコモ	67,500	2,570.50	173,508,750	
丹青社	85,000	1,057.00	89,845,000	
コナミホールディングス	15,000	4,895.00	73,425,000	
日鉄住金物産	7,500	4,605.00	34,537,500	
合計			16,512,574,500	

## (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。

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成30年1月11日から平成31年1月10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】

## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	55,046,728	64,320,910
親投資信託受益証券	3,860,958,579	4,252,751,973
未収入金	-	5,162,000
流動資産合計	3,916,005,307	4,322,234,883
資産合計	3,916,005,307	4,322,234,883
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	487,029	7,073,910
未払受託者報酬	988,773	1,161,537
未払委託者報酬	19,776,183	23,231,565
その他未払費用	148,228	175,657
流動負債合計	21,400,213	31,642,669
負債合計	21,400,213	31,642,669
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,218,600,901	1 2,605,579,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,676,004,193	1,685,012,509
（分配準備積立金）	812,297,413	718,125,584
元本等合計	3,894,605,094	4,290,592,214
純資産合計	3,894,605,094	4,290,592,214
負債純資産合計	3,916,005,307	4,322,234,883

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自	平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		8
有価証券売買等損益		318,666,808		217,325,606
<b>営業収益合計</b>		<b>318,666,808</b>		<b>217,325,598</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		24,372		33,464
受託者報酬		1,896,276		2,210,043
委託者報酬		1 37,926,898		1 44,202,486
その他費用		284,412		337,635
<b>営業費用合計</b>		<b>40,131,958</b>		<b>46,783,628</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>278,534,850</b>		<b>264,109,226</b>
経常利益又は経常損失（ ）		278,534,850		264,109,226
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>278,534,850</b>		<b>264,109,226</b>
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（ ）		13,191,646		12,812,985
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>1,290,597,682</b>		<b>1,676,004,193</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		380,876,329		481,759,810
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>380,876,329</b>		<b>481,759,810</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		260,813,022		221,455,253
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>260,813,022</b>		<b>221,455,253</b>
分配金		2 -		2 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,676,004,193</b>		<b>1,685,012,509</b>



## (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13期	
	自 平成30年1月11日	至 平成31年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首元本額	2,056,311,949円	2,218,600,901円
期中追加設定元本額	577,484,738円	682,462,389円
期中一部解約元本額	415,195,786円	295,483,585円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,218,600,901口	2,605,579,705口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	自 平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	5,562,040円	6,560,072円

2. 2 分配金の計算過程	<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(265,355,609円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,051,239,777円)及び分配準備積立金(546,941,804円)より分配可能額は1,863,537,190円(1万口当たり8,399.61円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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(1,470,454,132円)及び分配準備積立金(718,125,584円)より分配可能額は2,188,579,716円(1万口当たり8,399.59円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
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13期 平成31年1月10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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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）
親投資信託受益証券	301,273,295	215,887,887
合計	301,273,295	215,887,887

## （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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7554円 (17,554円)	1.6467円 (16,467円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	外国債券インデックスマザーファンド	261,594,952	703,742,739	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	565,614,868	725,005,137	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	317,016,351	691,254,153	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	277,930,622	706,221,710	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	206,831,439	509,529,249	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	110,309,660	163,710,566	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	17,430,598	31,209,485	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	277,551,866	722,078,934	
親投資信託受益証券 合計			4,252,751,973	
合計			4,252,751,973	

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、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成30年1月11日から平成31年1月10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】

## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	61,567,734	68,698,555
親投資信託受益証券	4,046,204,599	4,385,690,128
未収入金	-	1,371,000
流動資産合計	4,107,772,333	4,455,759,683
資産合計	4,107,772,333	4,455,759,683
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,675,840	1,746,683
未払受託者報酬	1,007,485	1,218,300
未払委託者報酬	23,173,150	28,021,717
その他未払費用	151,034	184,243
流動負債合計	26,007,509	31,170,943
負債合計	26,007,509	31,170,943
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,170,099,737	1 2,571,575,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,911,665,087	1,853,013,579
（分配準備積立金）	950,877,074	845,241,642
元本等合計	4,081,764,824	4,424,588,740
純資産合計	4,081,764,824	4,424,588,740
負債純資産合計	4,107,772,333	4,455,759,683

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自	平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
営業収益				
受取利息		-		9
有価証券売買等損益		440,733,479		329,013,471
営業収益合計		440,733,479		329,013,462
営業費用				
支払利息		25,296		35,953
受託者報酬		1,918,217		2,305,156
委託者報酬		1 44,120,803		1 53,020,474
その他費用		287,717		352,352
営業費用合計		46,352,033		55,713,935
営業利益又は営業損失( )		394,381,446		384,727,397
経常利益又は経常損失( )		394,381,446		384,727,397
当期純利益又は当期純損失( )		394,381,446		384,727,397
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( )		14,432,987		17,954,030
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,382,118,784		1,911,665,087
剰余金増加額又は欠損金減少額		402,341,071		547,753,097
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		402,341,071		547,753,097
剰余金減少額又は欠損金増加額		252,743,227		239,631,238
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		252,743,227		239,631,238
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,911,665,087		1,853,013,579



## (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13期	
	自 平成30年1月11日	至 平成31年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	平成30年1月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首元本額	1,992,388,997円	2,170,099,737円
期中追加設定元本額	541,348,837円	676,061,653円
期中一部解約元本額	363,638,097円	274,586,229円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,170,099,737口	2,571,575,161口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	自 平成29年1月11日 至 平成30年1月10日	自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	7,582,933円	9,229,243円

2. 2 分配金の計算過程	<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(379,961,669円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,235,688,485円)及び分配準備積立金(570,915,405円)より分配可能額は2,186,565,559円(1万口当たり10,075.88円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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(1,745,842,252円)及び分配準備積立金(845,241,642円)より分配可能額は2,591,083,894円(1万口当たり10,075.86円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
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13期 平成31年1月10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
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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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）
親投資信託受益証券	425,659,758	326,071,640
合計	425,659,758	326,071,640

## （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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10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13期 自 平成30年1月11日 至 平成31年1月10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12期 平成30年1月10日現在	第13期 平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8809円 (18,809円)	1.7206円 (17,206円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	外国債券インデックスマザーファンド	82,438,806	221,776,875	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	178,625,800	228,962,550	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	393,487,604	857,999,720	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	423,062,754	1,075,002,457	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	316,069,867	778,638,117	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	171,087,259	253,910,601	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	26,885,180	48,137,914	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	354,113,582	921,261,894	
親投資信託受益証券 合計			4,385,690,128	
合計			4,385,690,128	

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、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2019年1月11日から2019年7月10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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2019年7月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	11,793,888
コール・ローン	44,805,208
親投資信託受益証券	4,186,608,929
未収入金	6,067,000
流動資産合計	4,249,275,025
資産合計	4,249,275,025
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	6,186,187
未払受託者報酬	1,050,815
未払委託者報酬	17,864,742
その他未払費用	157,620
流動負債合計	25,259,364
負債合計	25,259,364
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 2,500,843,985
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,723,171,676
（分配準備積立金）	517,977,178
元本等合計	4,224,015,661
純資産合計	4,224,015,661
負債純資産合計	4,249,275,025

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	296,038,656
<b>営業収益合計</b>	<b>296,038,656</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	15,465
受託者報酬	1,050,815
委託者報酬	17,864,742
その他費用	158,070
<b>営業費用合計</b>	<b>19,089,092</b>
営業利益又は営業損失（ ）	276,949,564
経常利益又は経常損失（ ）	276,949,564
中間純利益又は中間純損失（ ）	276,949,564
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	11,103,866
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,308,066,757
剰余金増加額又は欠損金減少額	239,412,704
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	239,412,704
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,153,483
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,153,483
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,723,171,676



## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,288,972,489円
期中追加設定元本額	368,268,928円
期中一部解約元本額	156,397,432円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,500,843,985口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するた めに要する費用	2,375,932円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6890円 (16,890円)

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年7月10日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		220,484,777
金銭信託		233,519,765
コール・ローン		887,146,133
国債証券		176,349,458,387
派生商品評価勘定		6,669,399
未収入金		481,257
未収利息		1,261,974,836
前払費用		40,718,929
流動資産合計		179,000,453,483
資産合計		179,000,453,483
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,362,242
未払金		33,824,731
未払解約金		71,412,188
その他未払費用		12,080
流動負債合計		106,611,241
負債合計		106,611,241
純資産の部		
元本等		
元本	1	63,301,152,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		115,592,689,837
元本等合計		178,893,842,242
純資産合計		178,893,842,242
負債純資産合計		179,000,453,483

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
----	------------------------------

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2019年1月11日 61,542,450,975円 3,516,259,167円 1,757,557,737円

## 期末元本額の内訳

## ファンド名

ダイワ外国債券インデックス V A	651,671,306円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	143,833,014円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	475,860,787円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	14,032,560円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	390,402,992円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,322,432,915円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマー ジングプラス(為替 ヘッジなし)	776,789,321円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,270,708円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	106,599円
iFree 外国債券イン デックス	568,398,836円
iFree 8資産バランス	632,187,292円
iFree 年金バランス	10,324,086円
DCダイワ外国債券インデッ クス	44,305,370,235円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	763,039,313円

ダイワ・ライフ・バランス50	380,982,323円
ダイワ・ライフ・バランス70	234,933,540円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	368,513,591円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	288,695,019円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	94,424,609円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,533,065円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,740,974円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	2,240,081円
ダイワつみたてインデックス外国債券	34,343,268円
ダイワつみたてインデックスバランス30	53,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	35,706円
ダイワつみたてインデックスバランス70	35,706円
ダイワ世界バランスファンド40VA	209,611,351円
ダイワ世界バランスファンド60VA	149,792,156円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,128,091,216円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	1,609,278円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	308,126,751円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	148,808,873円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	30,952,501円

ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	7,491,080円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,651,325,850円
ダイワライフスタイル25	34,516,678円
ダイワライフスタイル50	60,721,669円
ダイワライフスタイル75	16,674,518円
計	63,301,152,405円
2. 期末日における受益権の総数	63,301,152,405口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2019年7月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買 建	1,030,213,993	-	1,035,521,150	5,307,157
アメリカ・ドル	473,820,330	-	479,416,860	5,596,530
イギリス・ポンド	60,007,420	-	59,690,400	317,020
オーストラリア・ドル	3,844,074	-	3,845,910	1,836
カナダ・ドル	52,483,127	-	52,973,100	489,973
シンガポール・ドル	23,839,500	-	23,976,000	136,500
デンマーク・クローネ	7,828,953	-	7,803,720	25,233
ノルウェー・クローネ	14,377,500	-	14,327,420	50,080
メキシコ・ペソ	26,196,728	-	26,528,420	331,692
ユーロ	359,512,582	-	358,544,320	968,262
南アフリカ・ランド	8,303,779	-	8,415,000	111,221
合計	1,030,213,993	-	1,035,521,150	5,307,157

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	2.8261円



(1万口当たり純資産額)

(28,261円)

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年7月10日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
金銭信託		27,363,255
コール・ローン		103,953,539
国債証券		15,421,780,720
地方債証券		1,138,635,400
特殊債券		714,999,300
社債券		1,041,772,200
未収利息		32,349,407
前払費用		546,175
流動資産合計		18,481,399,996
資産合計		18,481,399,996
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,095,760
その他未払費用		138
流動負債合計		5,095,898
負債合計		5,095,898
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,125,547,866
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,350,756,232
元本等合計		18,476,304,098
純資産合計		18,476,304,098
負債純資産合計		18,481,399,996

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	13,344,778,620円
期中追加設定元本額	1,430,972,444円
期中一部解約元本額	650,203,198円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	51,528,750円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	228,073円
iFree 日本債券イン デックス	137,322,636円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,358,842,675円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	5,990,063,509円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,265,644,495円
	1,007,126,339円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	791,652,572円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	618,843,325円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	202,174,570円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	51,100,144円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	54,778,665円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	6,013,091円
ダイワつみたてインデックス日本債券	72,276,933円
ダイワつみたてインデックスバランス30	419,453円
ダイワつみたてインデックスバランス50	305,057円
ダイワつみたてインデックスバランス70	152,529円
ダイワ世界バランスファンド40VA	322,212,709円
ダイワ世界バランスファンド60VA	192,563,640円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	2,298,701円
計	14,125,547,866円
2. 期末日における受益権の総数	14,125,547,866口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日現在	
該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

2019年7月10日現在	
1口当たり純資産額	1.3080円
(1万口当たり純資産額)	(13,080円)

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2019年7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,073,454,287
金銭信託	127,251,217
コール・ローン	483,429,848
投資証券	89,223,153,457
未収入金	60,864,908
未収配当金	398,286,543
流動資産合計	93,366,440,260
資産合計	93,366,440,260
負債の部	
流動負債	
未払金	107,748,159
未払解約金	101,329,000
その他未払費用	11,183
流動負債合計	209,088,342
負債合計	209,088,342
純資産の部	

元本等		
元本	1	35,779,122,556
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		57,378,229,362
元本等合計		93,157,351,918
純資産合計		93,157,351,918
負債純資産合計		93,366,440,260

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	40,758,891,506円
期中追加設定元本額	110,073,668円
期中一部解約元本額	5,089,842,618円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	31,995,471,467円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	29,873,469円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,336,009円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,866,593円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	72,625,140円
6資産バランスファンド（分配型）	130,996,273円
6資産バランスファンド（成長型）	305,284,993円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,471,779,837円

世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	42,705,418円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	3,832,381円
常陽3分法ファンド	192,668,259円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	44,888,266円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	245,753,385円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	322,894,057円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	421,672,245円
ダイワ・グローバルREIT ファンド(ダイワSMA専 用)	30,273,435円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	382,369,657円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り)	24,062,316円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	30,769,356円
計	35,779,122,556円
2. 期末日における受益権の総数	35,779,122,556口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日 現在	
該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

2019年7月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6037円 (26,037円)

「ダイワ」-REITアクティブ・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7月10日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
金銭信託	313,500,816	
コール・ローン	1,190,995,702	
投資証券	116,188,545,760	
未収入金	1,152,806,325	
未収配当金	819,637,540	
流動資産合計	119,665,486,143	
資産合計	119,665,486,143	
負債の部		
流動負債		
未払金	1,176,411,625	
未払解約金	59,459,000	
その他未払費用	1,772	
流動負債合計	1,235,872,397	
負債合計	1,235,872,397	
純資産の部		
元本等		
元本	1	40,010,264,096
剰余金		



期末剰余金又は期末欠損金（ ）	78,419,349,650
元本等合計	118,429,613,746
純資産合計	118,429,613,746
負債純資産合計	119,665,486,143

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	40,074,865,523円
期中追加設定元本額	2,112,229,819円
期中一部解約元本額	2,176,831,246円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,528,007円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,779,651円

成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	64,354,357円
6資産バランスファンド(分配型)	115,455,065円
6資産バランスファンド(成長型)	269,130,340円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	38,966,346円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	1,632,508円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	39,286,537円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	214,120,897円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	280,990,043円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	367,492,945円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	349,670,089円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	37,383,673,283円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)	86,982,705円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)	29,733,475円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	138,881,680円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	602,586,168円
計	40,010,264,096円
2. 期末日における受益権の総数	40,010,264,096口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,960円
(1万口当たり純資産額)	(29,600円)

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」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7月10日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	94,848,837
金銭信託	16,648,706
コール・ローン	63,248,756
株式	1,787,559,465
ハイブリッド優先証券	521,516,508
投資証券	50,429,295
未収入金	2,449,133
未収配当金	3,019,221

未収利息		749,674
流動資産合計		2,540,469,595
資産合計		2,540,469,595
負債の部		
流動負債		
未払金		7,136,113
未払解約金		1,194,000
その他未払費用		10,894
流動負債合計		8,341,007
負債合計		8,341,007
純資産の部		
元本等		
元本	1	893,251,838
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,638,876,750
元本等合計		2,532,128,588
純資産合計		2,532,128,588
負債純資産合計		2,540,469,595

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	889,650,063円
期中追加設定元本額	57,111,355円
期中一部解約元本額	53,509,580円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	9,742,913円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,922,010円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	156,896,375円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	28,090,088円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	27,339,181円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	107,141,744円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	210,542,659円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	344,576,868円
計	893,251,838円
2. 期末日における受益権の総数	893,251,838口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,8347円
(1万口当たり純資産額)	(28,347円)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」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7月10日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	88,541,584
金銭信託	3,790,410
コール・ローン	14,399,843
株式	1,133,597,018
未収配当金	2,006,399
流動資産合計	1,242,335,254
資産合計	1,242,335,254

負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,105,000
その他未払費用		10,820
流動負債合計		2,115,820
負債合計		2,115,820
純資産の部		
元本等		
元本	1	765,947,489
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		474,271,945
元本等合計		1,240,219,434
純資産合計		1,240,219,434
負債純資産合計		1,242,335,254

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引



	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	772,639,327円
期中追加設定元本額	47,306,132円
期中一部解約元本額	53,997,970円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,012,828円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	15,014,459円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	270,509,332円

ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	47,849,484円
ダイワ資産分散インカムオー プン（奇数月決算型）	46,861,615円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	59,715,944円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	117,227,818円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	191,756,009円
計	765,947,489円
2. 期末日における受益権の総数	765,947,489口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1.6192円
（1万口当たり純資産額）	（16,192円）

## 「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」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7月10日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		24,904,345
金銭信託		224,827
コール・ローン		854,122
株式		703,503,427
投資証券		30,129,644
派生商品評価勘定		3,286
未収入金		226,800
未収配当金		2,729,862
流動資産合計		762,576,313
資産合計		762,576,313
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,026,000
その他未払費用		10,804
流動負債合計		1,036,804
負債合計		1,036,804
純資産の部		
元本等		
元本	1	392,738,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		368,800,819
元本等合計		761,539,509
純資産合計		761,539,509
負債純資産合計		762,576,313

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	399,914,948円
期中追加設定元本額	20,450,853円
期中一部解約元本額	27,627,111円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,129,257円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,486,286円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	225,055,359円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	39,781,844円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	38,767,812円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	10,114,796円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	20,026,301円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	32,377,035円
計	392,738,690円
2. 期末日における受益権の総数	392,738,690口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2019年7月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	8,377,286	-	8,374,000	3,286
オフショア・ 人民元	8,377,286	-	8,374,000	3,286
合計	8,377,286	-	8,374,000	3,286

## （注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	1.9390円
(1万口当たり純資産額)	(19,390円)

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	131,204,381
コール・ローン	498,447,995
株式	16,912,734,020
未収入金	42,096,730
未収配当金	31,097,050
流動資産合計	17,615,580,176
資産合計	17,615,580,176
負債の部	
流動負債	
未払金	68,495,358
未払解約金	9,306,000
その他未払費用	807
流動負債合計	77,802,165

負債合計		77,802,165
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,827,971,087
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		10,709,806,924
元本等合計		17,537,778,011
純資産合計		17,537,778,011
負債純資産合計		17,615,580,176

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日
期首元本額	6,925,910,602円
期中追加設定元本額	323,971,528円
期中一部解約元本額	421,911,043円
期末元本額の内訳	



ファンド名	
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	5,045,424,994円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	29,198,864円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	32,558,729円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	28,941,828円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	511,046,844円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	89,640,737円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	89,045,600円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	161,956,713円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	319,548,286円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	520,608,492円
計	6,827,971,087円
2. 期末日における受益権の総数	6,827,971,087口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年7月10日現在

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,5685円
(1万口当たり純資産額)	(25,685円)

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年1月11日から2019年7月10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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2019年7月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	14,904,680
コール・ローン	56,623,170
親投資信託受益証券	4,944,009,171
未収入金	2,505,000
流動資産合計	5,018,042,021
資産合計	5,018,042,021
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	3,445,942
未払受託者報酬	1,251,210
未払委託者報酬	25,024,840
その他未払費用	187,670
流動負債合計	29,909,662
負債合計	29,909,662
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 2,796,913,543
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,191,218,816
(分配準備積立金)	671,330,802
元本等合計	4,988,132,359
純資産合計	4,988,132,359
負債純資産合計	5,018,042,021

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	391,124,198
<b>営業収益合計</b>	<b>391,124,198</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	19,037
受託者報酬	1,251,210
委託者報酬	1,25,024,840
その他費用	188,233
<b>営業費用合計</b>	<b>26,483,320</b>
営業利益又は営業損失（ ）	364,640,878
経常利益又は経常損失（ ）	364,640,878
中間純利益又は中間純損失（ ）	364,640,878
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	15,310,104
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,685,012,509
剰余金増加額又は欠損金減少額	274,701,175
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	274,701,175
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,825,642
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,825,642
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	<b>2,191,218,816</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年1月11日	2019年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,605,579,705円
期中追加設定元本額	372,182,471円
期中一部解約元本額	180,848,633円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,796,913,543口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年1月11日	2019年7月10日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	3,753,524円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7834円 (17,834円)

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。



【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年1月11日から2019年7月10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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2019年7月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	16,955,217
コール・ローン	64,413,198
親投資信託受益証券	5,404,210,222
未収入金	3,736,000
流動資産合計	5,489,314,637
資産合計	5,489,314,637
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	5,331,248
未払受託者報酬	1,327,923
未払委託者報酬	30,543,282
その他未払費用	199,192
流動負債合計	37,401,645
負債合計	37,401,645
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 2,888,460,358
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,563,452,634
（分配準備積立金）	789,510,735
元本等合計	5,451,912,992
純資産合計	5,451,912,992
負債純資産合計	5,489,314,637

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	479,345,094
<b>営業収益合計</b>	479,345,094
<b>営業費用</b>	
支払利息	21,090
受託者報酬	1,327,923
委託者報酬	1,30,543,282
その他費用	199,799
<b>営業費用合計</b>	32,092,094
営業利益又は営業損失（ ）	447,253,000
経常利益又は経常損失（ ）	447,253,000
中間純利益又は中間純損失（ ）	447,253,000
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	19,267,155
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,853,013,579
剰余金増加額又は欠損金減少額	417,946,324
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	417,946,324
剰余金減少額又は欠損金増加額	135,493,114
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	135,493,114
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,563,452,634

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年1月11日	2019年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,571,575,161円
期中追加設定元本額	502,619,504円
期中一部解約元本額	185,734,307円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,888,460,358口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年1月11日	2019年7月10日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	5,368,597円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8875円 (18,875円)

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」に記載のとおりであります。

## 2 【ファンドの現況】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

## 【純資産額計算書】

2019年7月31日

資産総額	4,277,343,007円
負債総額	2,977,523円
純資産総額（ - ）	4,274,365,484円
発行済数量	2,532,818,510口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6876円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	182,382,983,582円
負債総額	930,070,896円
純資産総額（ - ）	181,452,912,686円
発行済数量	64,456,615,360口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.8151円

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	18,846,779,334円
負債総額	4,671,360円
純資産総額（ - ）	18,842,107,974円
発行済数量	14,366,619,203口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3115円

## (参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	91,423,486,965円
負債総額	576,892,962円
純資産総額( - )	90,846,594,003円
発行済数量	35,530,920,361口
1単位当たり純資産額( / )	2.5568円

## (参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	125,237,641,393円
負債総額	929,938,843円
純資産総額( - )	124,307,702,550円
発行済数量	41,387,200,032口
1単位当たり純資産額( / )	3.0035円

## (参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	2,573,469,877円
負債総額	23,115,122円
純資産総額( - )	2,550,354,755円
発行済数量	885,380,242口
1単位当たり純資産額( / )	2.8805円

## (参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	1,239,269,066円
負債総額	39円
純資産総額( - )	1,239,269,027円



発行済数量	775,554,441口
1単位当たり純資産額( / )	1.5979円

## (参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	790,814,902円
負債総額	33,006,944円
純資産総額( - )	757,807,958円
発行済数量	385,368,335口
1単位当たり純資産額( / )	1.9665円

## (参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	17,246,688,327円
負債総額	15,110,064円
純資産総額( - )	17,231,578,263円
発行済数量	6,736,189,761口
1単位当たり純資産額( / )	2.5581円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

## 純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	5,058,547,279円
負債総額	7,576,898円
純資産総額( - )	5,050,970,381円
発行済数量	2,833,713,170口
1単位当たり純資産額( / )	1.7825円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

純資産額計算書

2019年7月31日

資産総額	5,521,291,816円
負債総額	5,089,787円
純資産総額( - )	5,516,202,029円
発行済数量	2,922,981,694口
1単位当たり純資産額( / )	1.8872円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

## 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。

(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て）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。

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2019年7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. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

##### ハ. 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。

##### ニ. 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。

##### ホ. ファンド評価会議、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

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7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	71	138,765
追加型株式投資信託	711	15,434,496
株式投資信託 合計	782	15,573,261
単位型公社債投資信託	30	110,386
追加型公社債投資信託	14	1,395,748
公社債投資信託 合計	44	1,506,134
総合計	826	17,079,395



## 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。
- 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、当事業年度（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。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	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
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
<b>その他利益剰余金</b>		
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					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 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

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					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計		
		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ます。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式

は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されておりま。

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 其他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

#### (注1) 金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

###### (1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

###### (3) 有価証券及び投資有価証券

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

##### 負 債

###### (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

#### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 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、記載しておりません。

当事業年度(2019年3月31日)

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

## 2. 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す。

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

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

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

当事業年度（自 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。

#### 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4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更(大和アセットマネジメント株式会社に変更)

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 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 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円(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	(注1)
株式会社三井住友銀行	1,770,996	(注2)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注3)
株式会社りそな銀行	279,928	

(注1) 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おります。

(注2) 銀行法に基づき銀行業を営んでおります。

(注3) 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。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」および「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 518千ドル(約57百万円)(2018年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

<参考> 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 アムンディ・アイルランド・リミテッド

資本金の額 1,032,912ユーロ(約131百万円)(2018年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

## 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】

該当事項はありません。

#### <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。

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
  - ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- 使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日  
次の事項を記載することがあります。
  - ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載  
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。  
ファンドの形態等を記載することがあります。  
図案を採用することがあります。  
ファンドの管理番号等を記載することがあります。  
委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。  
UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。  
次の事項を記載することがあります。
  - ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。



**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

平成31年2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 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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）の平成30年1月11日から平成31年1月10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、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）の平成31年1月10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

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成31年2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 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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の平成30年1月11日から平成31年1月10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、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の平成31年1月10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

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成31年2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 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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成30年1月11日から平成31年1月10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、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の平成31年1月10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

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2019年8月9日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2019年1月11日から2019年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2019年7月10日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年1月11日から2019年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上



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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2019年8月9日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2019年1月11日から2019年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2019年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年1月11日から2019年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2019年8月9日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2019年1月11日から2019年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2019年7月10日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年1月11日から2019年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。