

## 【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】	2020年4月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【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】

2020年4月4日から2020年10月2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
	海外	債券
追加型投信	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

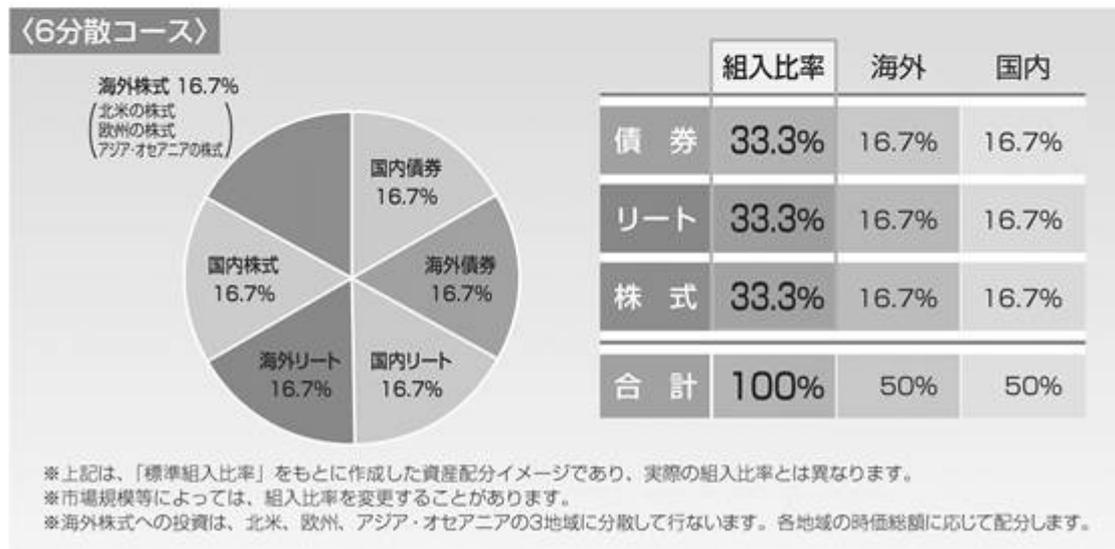
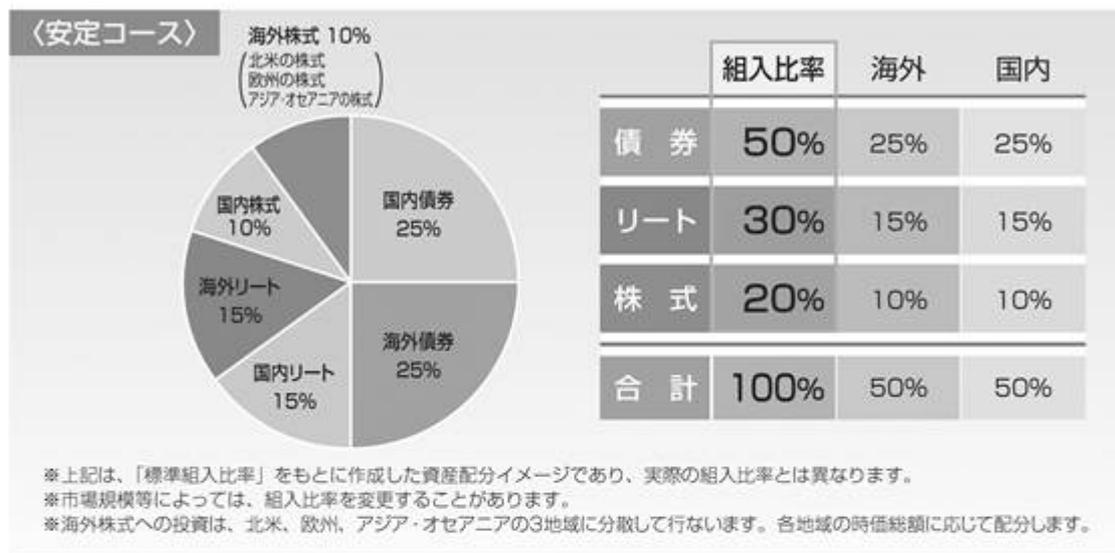
< 信託金の限度額 >

- ・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。



## 〈成長コース〉



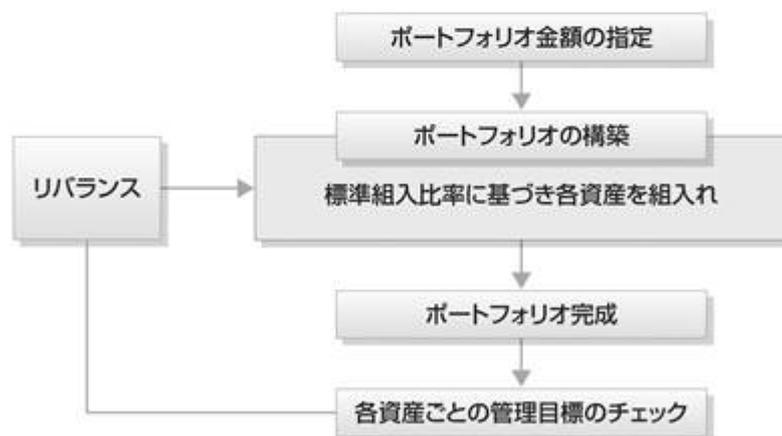
	組入比率	海外	国内
債券	10%	5%	5%
リート	40%	20%	20%
株式	50%	25%	25%
合計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※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。

※海外株式への投資は、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散して行ないます。各地域の時価総額に応じて配分します。

## 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

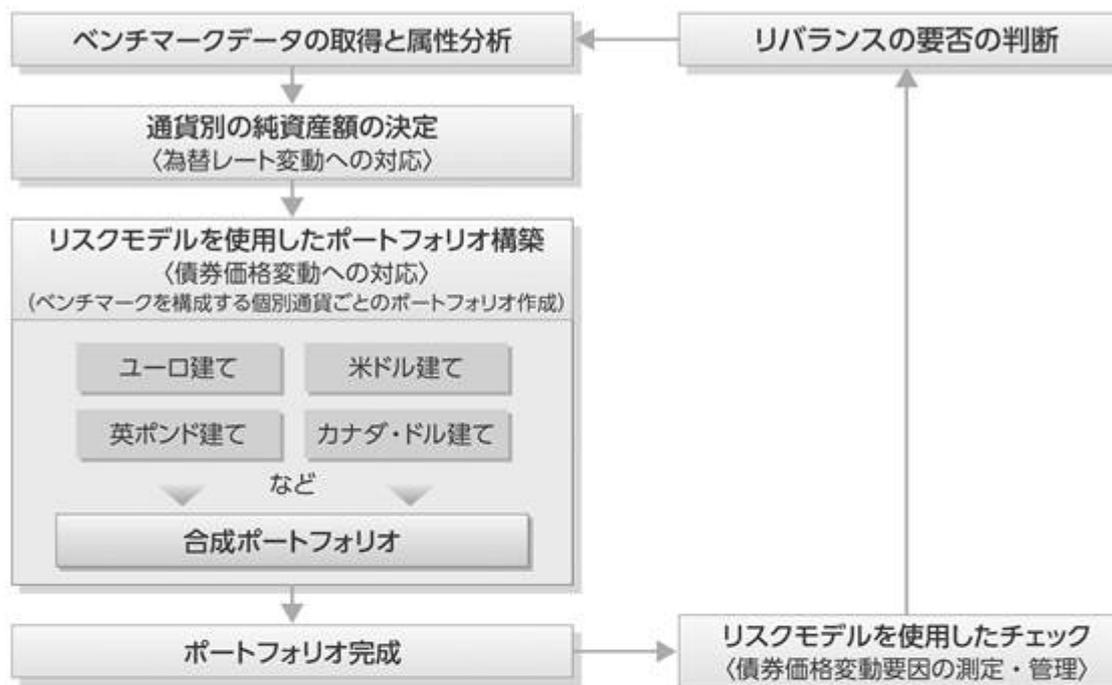
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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。

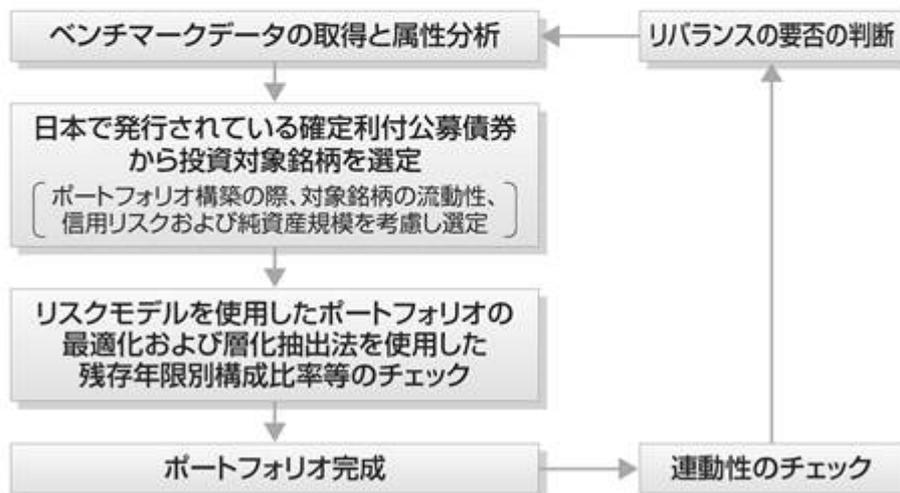
### FTSE世界国債インデックスとは

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。
- ・ 優先リートを含むハイブリッド証券などの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。

### 投資対象のイメージ



◆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



• 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とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～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	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないません。</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。

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

#### < 委託会社の概況(2020年1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-REIT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（BPI）の受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワJ-REIT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、大和アセットマネジメント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。）

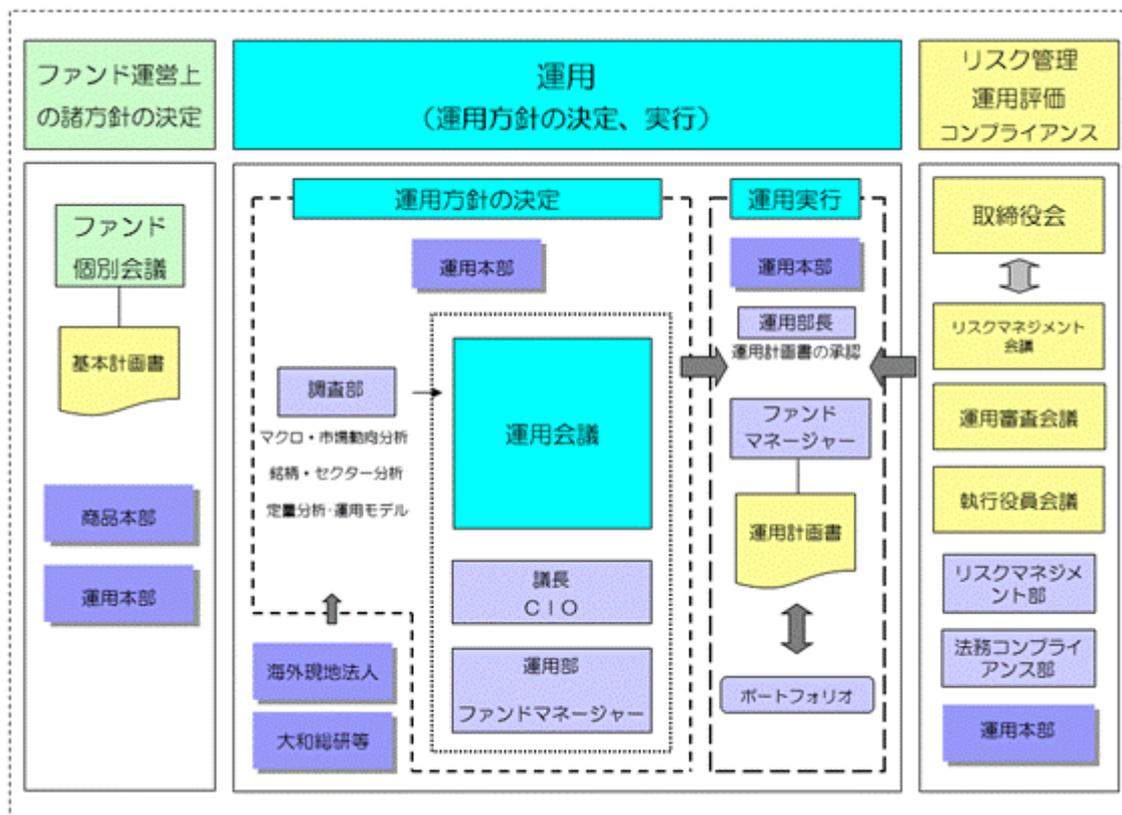
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長 (各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

### 運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．運用審査会議

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

ロ．リスクマネジメント会議

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

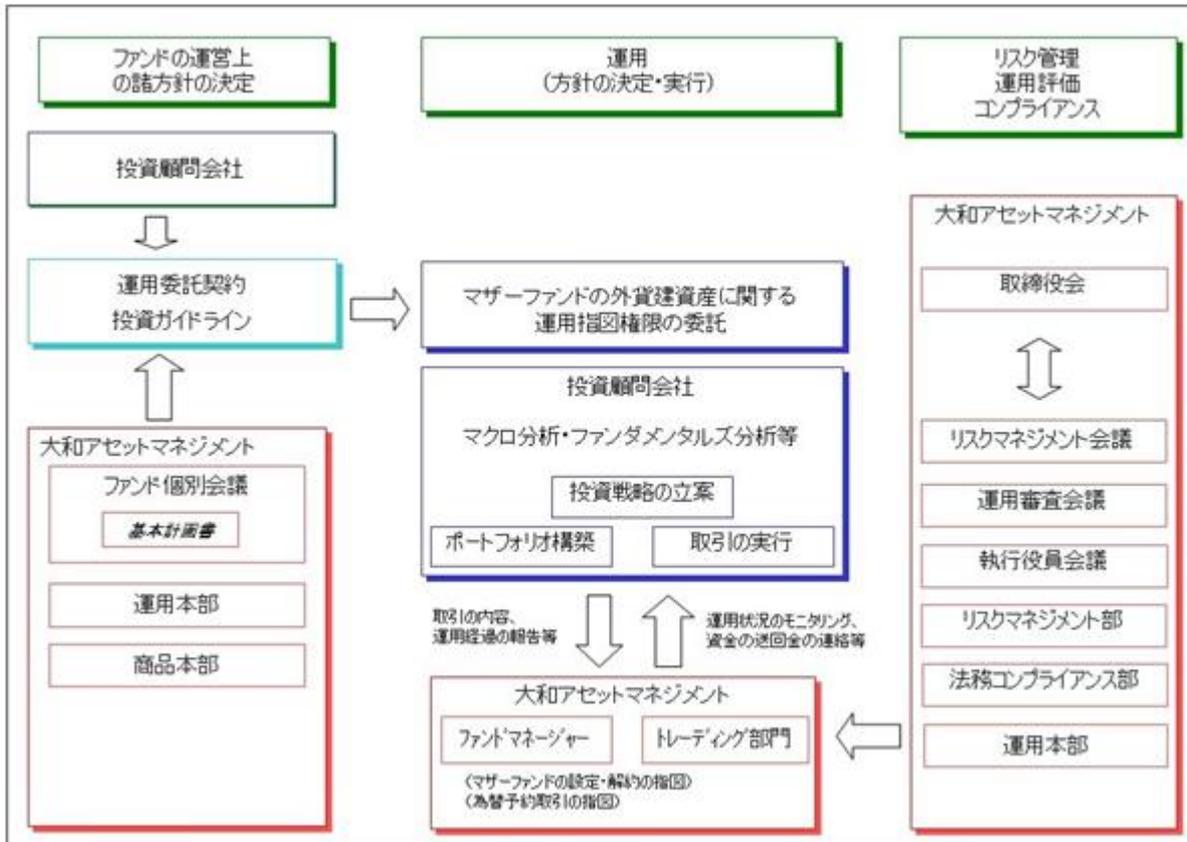
ハ．執行役員会議

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

## 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2020年1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せん。
- 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号口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、）の行使等により取得したものに限り、

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。

二．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。

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．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。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
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す。）。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す。

二．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。

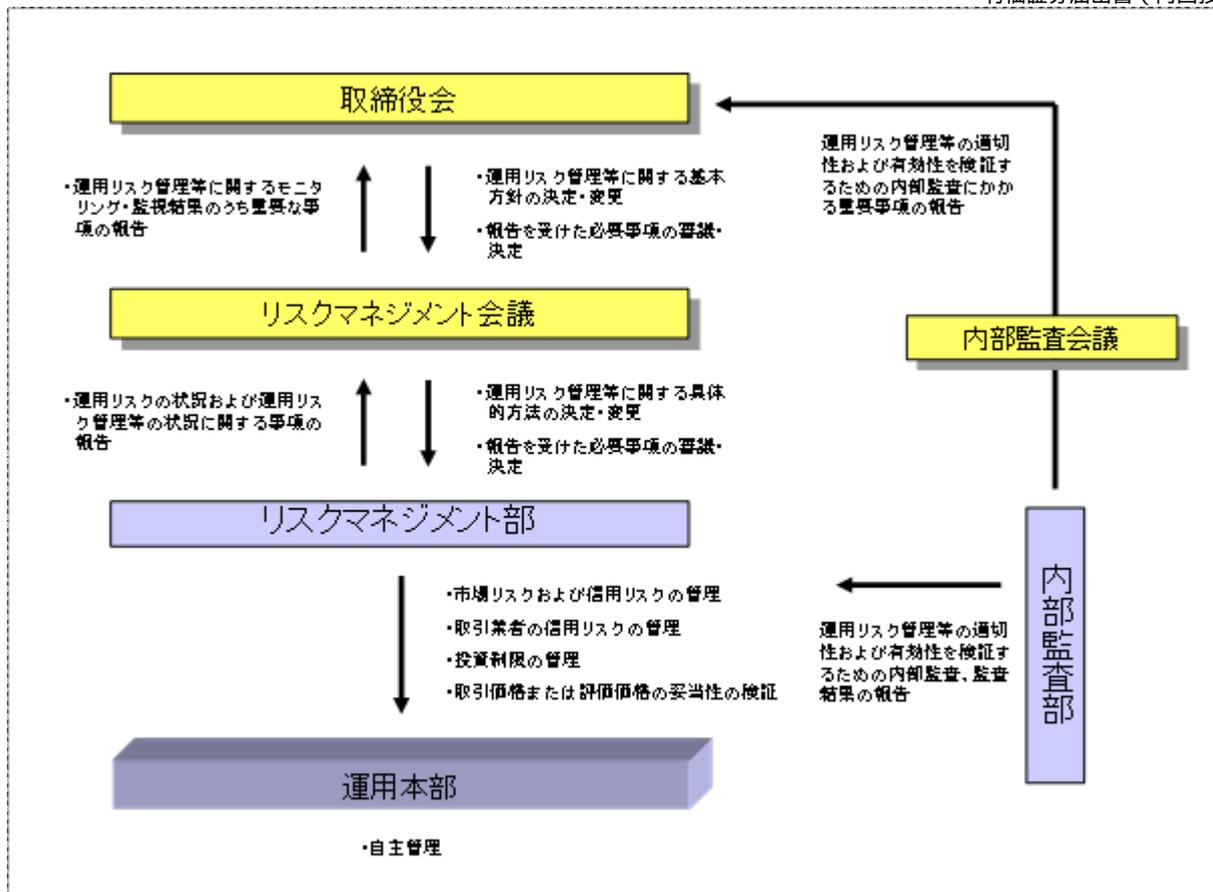
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

### (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

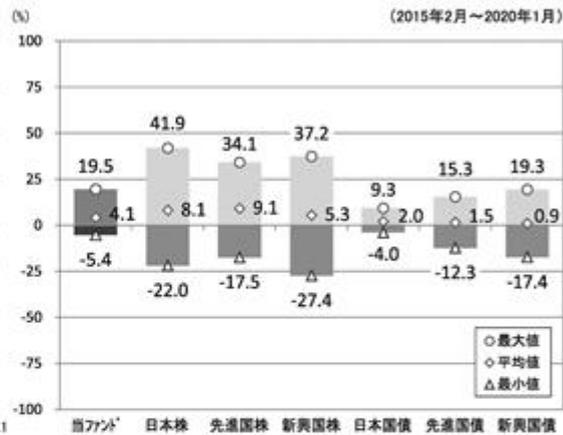
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

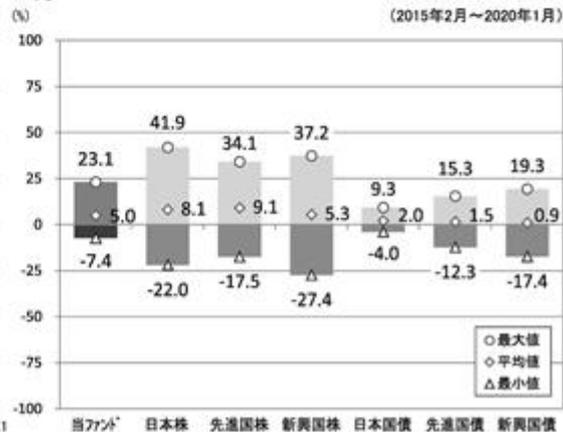
## [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）]



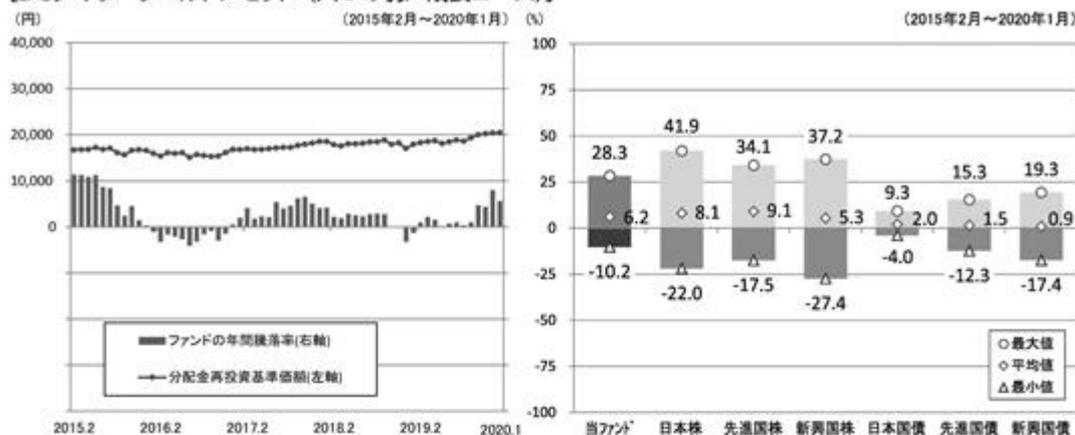
## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## [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、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発行した指数です。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。

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2020年1月末現在のものですので、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/安定コース)】

## (1) 【投資状況】 (2020年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,995,117,752	99.11
内 日本	4,995,117,752	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,750,421	0.89
純資産総額	5,039,868,173	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】 (2020年1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	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	430,219,341	2.8783 1,238,309,499	2.9132 1,253,314,984	24.87
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	954,246,516	1.2991 1,239,690,576	1.3071 1,247,295,621	24.75
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	224,961,690	3.2569 732,698,025	3.3807 760,527,985	15.09
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	264,211,944	2.7651 730,573,187	2.8380 749,833,497	14.88
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	175,333,362	2.8847 505,796,344	2.7944 489,951,546	9.72
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	116,604,963	3.1017 361,682,548	3.1052 362,081,731	7.18

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	65,178,434	1.7518 114,180,141	1.7138 111,702,800	2.22
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	10,226,782	2.1062 21,540,589	1.9957 20,409,588	0.40

(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
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	-
8月末日	4,380,634,586	-	1.6906	-
9月末日	4,542,669,249	-	1.7228	-
10月末日	4,757,481,570	-	1.7591	-
11月末日	4,866,320,352	-	1.7634	-
12月末日	4,920,599,519	-	1.7680	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
2020年1月末日	5,039,868,173	-	1.7800	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

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
第14計算期間	12.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第14計算期間	809,239,523	304,172,889

## (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 (2020年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	192,841,739,107	98.30
内 ユーロ	71,703,818,348	36.55
内 シンガポール	792,686,602	0.40
内 マレーシア	922,471,382	0.47
内 ノルウェー	408,528,316	0.21
内 スウェーデン	530,905,908	0.27
内 デンマーク	944,303,971	0.48
内 イギリス	12,844,234,098	6.55

内 ポーランド	1,074,039,799	0.55
内 カナダ	3,676,219,723	1.87
内 アメリカ	93,421,169,286	47.62
内 メキシコ	1,722,601,352	0.88
内 南アフリカ	1,077,382,484	0.55
内 オーストラリア	3,723,377,838	1.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,330,989,760	1.70
純資産総額	196,172,728,867	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)	1,421,852,470	0.72
内 日本	1,421,852,470	0.72

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

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

(注3) 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 (2020年1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	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,800,000	101.61 975,263,597	102.62 984,920,860	2.000000 2024/05/31	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	111.23 885,576,142	113.09 900,376,348	3.125000 2028/11/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,168,000	100.04 891,176,216	100.71 897,162,406	1.625000 2022/11/15	0.46
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	100.76 868,968,794	100.96 870,615,859	2.250000 2021/04/30	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,550,000	102.04 840,249,825	103.03 848,360,344	2.125000 2024/03/31	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	108.99 796,406,723	110.83 809,873,561	2.875000 2028/08/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	105.16 791,373,822	107.17 806,536,980	2.375000 2029/05/15	0.41

8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	107.23 771,866,042	109.17 785,808,491	2.625000 2029/02/15	0.40
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	108.81 771,357,386	110.61 784,152,851	2.875000 2028/05/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	99.50 762,803,487	101.09 774,961,489	1.625000 2026/05/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.53 741,519,770	100.66 757,510,692	1.625000 2029/08/15	0.39
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	107.65 739,680,691	109.46 752,075,578	2.750000 2028/02/15	0.38
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	101.83 721,898,131	103.45 733,367,971	2.000000 2026/11/15	0.37
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,284,000	182.31 720,278,864	184.43 728,630,600	4.500000 2041/04/25	0.37
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,366,000	99.67 692,004,307	101.11 702,031,022	1.625000 2026/02/15	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	103.32 694,392,802	104.39 701,529,736	2.375000 2024/08/15	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 693,319,044	101.76 697,762,122	2.000000 2022/11/30	0.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 667,377,619	105.49 678,792,493	2.250000 2027/08/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,800,000	125.03 654,522,281	129.50 677,916,960	3.375000 2048/11/15	0.35
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 664,154,428	104.01 671,670,892	2.250000 2024/11/15	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 656,762,897	104.59 666,163,694	2.250000 2025/11/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,700,000	104.53 649,858,330	106.24 660,444,893	2.375000 2027/05/15	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	102.32 645,934,530	103.70 654,614,070	2.125000 2025/05/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	117.10 625,810,361	121.38 648,658,125	3.000000 2049/02/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.75 637,336,225	103.14 645,998,391	2.000000 2025/08/15	0.33
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.71 637,091,956	103.00 645,165,370	2.000000 2025/02/15	0.33
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	103.78 622,509,572	105.57 633,288,517	2.250000 2027/11/15	0.32

28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	4,850,000	114.37 604,976,268	118.68 627,784,204	2.875000 2049/05/15	0.32
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,087,000	126.60 622,449,282	127.40 626,392,444	2.500000 2030/05/25	0.32
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,420,000	116.79 621,045,333	117.80 626,389,179	1.500000 2031/05/25	0.32

(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
国債証券	98.30%
合計	98.30%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年3月	買建	90,000	6,585,149	6,587,100	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2020年3月	買建	281,000	23,173,508	23,171,260	0.01%
		ユーロ買/円売 2020年3月	買建	5,534,000	665,750,714	665,850,880	0.34%
		英ポンド買/円売 2020年3月	買建	305,000	43,532,924	43,532,650	0.02%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2020年3月	買建	5,800,000	42,616,352	42,630,000	0.02%
		ノルウェー・クローネ 買/円売 2020年3月	買建	3,420,000	40,560,197	40,527,000	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2020年3月	買建	987,000	27,606,617	27,596,520	0.01%

米ドル買/円売 2020年3月	買建	5,183,000	564,386,199	564,221,380	0.29%
メキシコ・ペソ買/円売 2020年3月	買建	1,343,000	7,759,425	7,735,680	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(BPI)

### (1) 投資状況 (2020年1月31日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	18,104,906,550	84.73
内 日本	18,104,906,550	84.73
地方債証券	1,463,879,600	6.85
内 日本	1,463,879,600	6.85
特殊債証券	631,900,500	2.96
内 日本	631,900,500	2.96
社債券	837,009,000	3.92
内 日本	837,009,000	3.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	329,860,228	1.54
純資産総額	21,367,555,878	100.00

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

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

### (2) 投資資産 (2020年1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 (%)
1 345 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.85 285,188,400	101.91 285,359,200	0.100000 2026/12/20	1.34
2 137 5年国債	日本	国債証券	250,000,000	100.99 252,495,500	101.02 252,555,000	0.100000 2023/09/20	1.18

3	138 5年国債	日本	国債証券	240,000,000	101.05 242,540,000	101.09 242,623,200	0.100000 2023/12/20	1.14
4	135 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.96 232,210,300	100.87 232,021,700	0.100000 2023/03/20	1.09
5	133 5年国債	日本	国債証券	230,000,000	100.83 231,916,100	100.73 231,699,700	0.100000 2022/09/20	1.08
6	128 5年国債	日本	国債証券	227,000,000	100.41 227,948,860	100.35 227,796,770	0.100000 2021/06/20	1.07
7	334 10年国債	日本	国債証券	220,000,000	103.50 227,706,600	103.41 227,517,400	0.600000 2024/06/20	1.06
8	356 10年国債	日本	国債証券	218,000,000	101.45 221,163,480	101.69 221,699,460	0.100000 2029/09/20	1.04
9	130 5年国債	日本	国債証券	217,000,000	100.56 218,223,880	100.48 218,061,130	0.100000 2021/12/20	1.02
10	335 10年国債	日本	国債証券	210,000,000	103.21 216,751,500	103.14 216,610,800	0.500000 2024/09/20	1.01
11	349 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.92 203,851,200	101.99 203,984,000	0.100000 2027/12/20	0.95
12	352 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.76 203,534,100	101.87 203,746,000	0.100000 2028/09/20	0.95
13	353 10年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.61 203,237,250	101.83 203,672,000	0.100000 2028/12/20	0.95
14	140 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.19 202,380,000	101.21 202,424,000	0.100000 2024/06/20	0.95
15	139 5年国債	日本	国債証券	200,000,000	101.16 202,334,000	101.16 202,326,000	0.100000 2024/03/20	0.95
16	131 5年国債	日本	国債証券	190,000,000	100.64 191,223,600	100.56 191,071,600	0.100000 2022/03/20	0.89
17	350 10年国債	日本	国債証券	185,000,000	101.97 188,644,500	101.97 188,648,200	0.100000 2028/03/20	0.88
18	347 10年国債	日本	国債証券	180,000,000	101.94 183,502,800	101.97 183,560,400	0.100000 2027/06/20	0.86
19	129 5年国債	日本	国債証券	182,000,000	100.49 182,900,900	100.42 182,771,680	0.100000 2021/09/20	0.86
20	406 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.52 180,948,600	100.45 180,817,200	0.100000 2021/11/01	0.85
21	348 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.97 173,352,400	102.00 173,411,900	0.100000 2027/09/20	0.81
22	141 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	101.23 172,100,600	101.25 172,140,300	0.100000 2024/09/20	0.81

23	134 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.85 171,455,300	100.80 171,375,300	0.100000 2022/12/20	0.80
24	132 5年国債	日本	国債証券	170,000,000	100.71 171,215,500	100.64 171,093,100	0.100000 2022/06/20	0.80
25	329 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.49 165,593,600	103.31 165,296,000	0.800000 2023/06/20	0.77
26	340 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	103.30 165,291,200	103.26 165,227,200	0.400000 2025/09/20	0.77
27	325 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	102.74 164,384,000	102.56 164,096,000	0.800000 2022/09/20	0.77
28	351 10年国債	日本	国債証券	160,000,000	101.89 163,038,400	101.90 163,046,400	0.100000 2028/06/20	0.76
29	403 2年国債	日本	国債証券	160,000,000	100.45 160,731,200	100.38 160,608,000	0.100000 2021/08/01	0.75
30	319 10年国債	日本	国債証券	140,000,000	102.59 143,635,800	102.36 143,306,800	1.100000 2021/12/20	0.67

(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
国債証券	84.73%
地方債証券	6.85%
特殊債券	2.96%
社債券	3.92%
合計	98.46%

(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・グローバルREIT・マザーファンド

## (1) 投資状況（2020年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	89,836,639,382	97.36
内 香港	2,904,904,452	3.15
内 シンガポール	6,868,878,743	7.44
内 イギリス	9,826,368,739	10.65
内 オランダ	315,666,659	0.34
内 ベルギー	2,816,132,602	3.05
内 フランス	4,596,093,543	4.98
内 ドイツ	720,978,260	0.78
内 スペイン	1,637,920,870	1.78
内 カナダ	3,456,302,599	3.75
内 アメリカ	45,569,323,624	49.38
内 オーストラリア	9,863,950,013	10.69
内 ニュージーランド	1,260,119,278	1.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,438,413,859	2.64
純資産総額	92,275,053,241	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)	229,194,571	0.25
内 日本	229,194,571	0.25
為替予約取引(売建)	229,481,038	0.25
内 日本	229,481,038	0.25

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

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

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

## (2) 投資資産（2020年1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	UDR INC	アメリカ	投資証券	727,354	5,259.63 3,825,621,111	5,254.51 3,821,889,448	4.14

2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	52,104	61,506.89 3,204,756,279	65,763.18 3,426,524,731	3.71
3	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	293,190	9,294.09 2,724,935,185	10,492.66 3,076,343,748	3.33
4	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	90,240	35,368.15 3,191,622,578	34,040.89 3,071,850,617	3.33
5	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,782,121	997.77 2,775,988,923	1,095.68 3,048,329,639	3.30
6	LINK REIT	香港	投資証券	2,609,105	1,235.64 3,223,942,376	1,113.37 2,904,904,452	3.15
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	291,900	9,480.58 2,767,382,995	9,313.72 2,718,676,036	2.95
8	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	9,647,413	222.80 2,149,459,052	249.18 2,404,000,256	2.61
9	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	90,510	25,495.28 2,307,585,330	24,440.34 2,212,095,716	2.40
10	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	7,595,977	245.40 1,864,229,606	286.02 2,172,665,148	2.35
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	176,226	12,181.34 2,146,678,882	12,059.85 2,125,259,972	2.30
12	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,547,349	1,370.26 2,120,314,031	1,357.26 2,100,162,640	2.28
13	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	11,504,841	142.77 1,643,087,770	181.07 2,083,195,366	2.26
14	KLEPIERRE	フランス	投資証券	533,028	3,602.14 1,920,049,567	3,779.82 2,014,753,093	2.18
15	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	140,352	13,638.49 1,914,196,579	13,713.20 1,924,675,664	2.09
16	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	412,199	4,316.78 1,779,405,132	4,570.81 1,884,083,847	2.04
17	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	643,094	2,410.22 1,550,001,879	2,926.07 1,881,744,363	2.04
18	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	125,276	16,703.19 2,092,517,295	14,881.23 1,864,261,846	2.02
19	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,429,831	1,091.81 1,561,107,418	1,300.97 1,860,173,269	2.02
20	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	215,648	8,107.95 1,748,480,066	8,613.55 1,857,496,728	2.01
21	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	438,976	3,644.45 1,599,844,434	4,005.77 1,758,438,560	1.91

22	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	480,383	3,074.40 1,476,890,168	3,436.48 1,650,826,860	1.79
23	GECINA SA	フランス	投資証券	79,649	17,237.18 1,372,926,518	20,475.06 1,630,818,054	1.77
24	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	397,407	3,622.44 1,439,586,391	3,956.19 1,572,218,752	1.70
25	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,672,314	812.85 1,359,421,825	928.58 1,552,884,525	1.68
26	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	1,363,816	1,052.64 1,435,672,395	1,066.60 1,454,655,420	1.58
27	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	9,195,718	131.18 1,206,377,968	157.57 1,449,001,470	1.57
28	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	4,066,599	286.71 1,166,023,641	346.66 1,409,734,123	1.53
29	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	241,899	5,620.29 1,359,566,494	5,798.72 1,402,704,618	1.52
30	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	イギリス	投資証券	4,232,039	302.45 1,280,401,353	325.45 1,377,350,356	1.49

(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	97.36%
合計	97.36%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2020年 2月	買建	78,881	11,257,521	11,268,097	0.01%

米ドル買/円売 2020年2月	買建	1,998,592	218,250,870	217,926,474	0.24%
シンガポール・ドル売/円買 2020年2月	売建	597,457	47,868,230	47,856,281	0.05%
ユーロ売/円買 2020年2月	売建	603,661	72,620,389	72,620,389	0.08%
米ドル売/円買 2020年2月	売建	103,223	11,257,521	11,255,456	0.01%
豪ドル売/円買 2020年2月	売建	1,333,910	97,762,251	97,748,912	0.11%

(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 (2020年1月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	116,179,195,000	96.80
内 日本	116,179,195,000	96.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,842,209,604	3.20
純資産総額	120,021,404,604	100.00

##### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,494,312,000	1.25
内 日本	1,494,312,000	1.25

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

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

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

#### (2) 投資資産 (2020年1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	11,119	716,324.78 7,964,815,242	791,000.00 8,795,129,000	7.33
2	野村不動産マスターF	日本	投資証券	41,352	193,567.13 8,004,388,229	190,800.00 7,889,961,600	6.57
3	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	24,654	300,500.00 7,408,527,000	289,500.00 7,137,333,000	5.95
4	日本ビルファンド	日本	投資証券	7,709	798,000.00 6,151,782,000	878,000.00 6,768,502,000	5.64
5	GLP投資法人	日本	投資証券	37,815	135,252.08 5,114,557,657	145,300.00 5,494,519,500	4.58
6	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	6,214	818,352.83 5,085,244,525	870,000.00 5,406,180,000	4.50
7	日本リテールファンド	日本	投資証券	20,354	243,100.00 4,948,057,400	231,700.00 4,716,021,800	3.93
8	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	40,722	94,921.22 3,865,381,924	93,000.00 3,787,146,000	3.16
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	16,020	235,900.00 3,779,118,000	229,300.00 3,673,386,000	3.06
10	森ヒルズリート	日本	投資証券	19,770	172,600.00 3,412,302,000	181,700.00 3,592,209,000	2.99
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	47,101	85,309.69 4,018,171,951	73,100.00 3,443,083,100	2.87
12	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	27,551	100,454.78 2,767,629,711	107,700.00 2,967,242,700	2.47
13	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	53,215	62,058.58 3,302,447,786	54,900.00 2,921,503,500	2.43
14	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	13,067	210,200.00 2,746,683,400	215,200.00 2,812,018,400	2.34
15	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	20,972	115,220.91 2,416,413,073	127,500.00 2,673,930,000	2.23
16	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	7,724	348,000.00 2,687,952,000	341,500.00 2,637,746,000	2.20
17	森トラスト総合リート	日本	投資証券	13,233	190,725.40 2,523,869,255	198,900.00 2,632,043,700	2.19
18	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,776	447,763.14 2,138,516,802	525,000.00 2,507,400,000	2.09

19	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	6,328	346,500.00 2,192,652,000	357,000.00 2,259,096,000	1.88
20	星野リゾート・リート	日本	投資証券	3,895	573,000.00 2,231,835,000	558,000.00 2,173,410,000	1.81
21	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	11,052	209,838.90 2,319,139,595	194,300.00 2,147,403,600	1.79
22	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	7,060	275,081.55 1,942,075,759	293,400.00 2,071,404,000	1.73
23	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,350	838,000.00 1,969,300,000	870,000.00 2,044,500,000	1.70
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	10,162	197,539.60 2,007,397,427	200,900.00 2,041,545,800	1.70
25	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	6,864	276,615.26 1,898,687,170	268,500.00 1,842,984,000	1.54
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	11,067	156,203.02 1,728,698,906	160,400.00 1,775,146,800	1.48
27	SOSILA物流リート投	日本	投資証券	14,178	113,426.11 1,608,155,440	122,700.00 1,739,640,600	1.45
28	福岡リート投資法人	日本	投資証券	9,039	181,500.00 1,640,578,500	187,700.00 1,696,620,300	1.41
29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	3,921	352,030.55 1,380,311,790	397,500.00 1,558,597,500	1.30
30	イオンリート投資	日本	投資証券	9,351	148,728.29 1,390,758,243	147,800.00 1,382,077,800	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。

#### 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	96.80%
合計	96.80%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2020年3月	買建	678	1,456,960,980	1,494,312,000	1.25%

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

(注2) 不動産投信指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

### (1) 投資状況 (2020年1月31日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,257,154,707	79.37
内 カナダ	66,707,341	2.35
内 アメリカ	2,190,447,366	77.03
ハイブリッド優先証券	496,562,201	17.46
内 アメリカ	496,562,201	17.46
投資証券	31,177,487	1.10
内 アメリカ	31,177,487	1.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	58,823,709	2.07
純資産総額	2,843,718,104	100.00

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

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

### (2) 投資資産 (2020年1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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	3,367	26,479.22 89,155,598	35,321.26 118,926,690	4.18
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,743	15,686.97 90,090,564	18,843.38 108,217,570	3.81

3	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	2,794	25,750.26 71,946,343	29,438.56 82,251,353	2.89
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,551	14,882.65 67,731,336	16,398.26 74,628,489	2.62
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	132,809.99 62,420,698	158,600.50 74,542,237	2.62
6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	357	191,472.17 68,355,575	204,016.36 72,833,841	2.56
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,255	13,621.04 57,957,828	14,820.16 63,059,795	2.22
8	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,902	25,609.46 48,709,210	28,997.96 55,154,126	1.94
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	2,246	19,342.88 43,444,112	22,707.38 51,000,781	1.79
10	SUNCOR ENERGY INC	カナダ	株式	エネルギー	14,573	3,262.18 47,540,092	3,437.40 50,093,261	1.76
11	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	7,719	6,510.22 50,252,562	6,473.80 49,971,275	1.76
12	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	11,959	4,139.59 49,505,815	4,082.11 48,818,023	1.72
13	HORMEL FOODS CORP	アメリカ	株式	生活必需品	9,024	5,080.77 45,849,269	5,221.79 47,121,458	1.66
14	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	2,271	19,846.95 45,072,637	20,249.17 45,985,866	1.62
15	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,289	31,622.49 40,761,547	34,375.71 44,310,293	1.56
16	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,970	10,197.11 40,482,527	10,924.54 43,370,425	1.53
17	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,337	11,731.58 39,148,296	12,885.43 42,998,710	1.51
18	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	11,401	3,295.90 37,576,997	3,651.32 41,628,800	1.46

19	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーショ ン・サー ビス	1,641	23,998.65 39,381,862	22,851.34 37,499,052	1.32
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	4,962	5,631.85 27,945,281	7,249.21 35,970,621	1.26
21	NORTHROP GRUMMAN CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	829	39,961.76 33,128,303	41,973.92 34,796,382	1.22
22	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	1,346	25,142.80 33,842,224	25,388.07 34,172,352	1.20
23	WILLIS TOWERS WATSON PLC	アメリカ	株式	金融	1,435	20,464.01 29,365,866	23,420.63 33,608,611	1.18
24	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	1,950	16,870.49 32,897,458	16,810.50 32,780,491	1.15
25	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	2,319	12,667.31 29,375,513	13,388.20 31,047,249	1.09
26	TELEFLEX INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	721	35,460.74 25,567,242	41,497.33 29,919,575	1.05
27	AMERICAN EXPRESS CO	アメリカ	株式	金融	2,028	12,693.49 25,742,405	14,528.97 29,464,758	1.04
28	HERSHEY CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	1,707	16,945.74 28,926,383	17,246.74 29,440,200	1.04
29	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	アメリカ	株式	素材	1,109	23,323.57 25,865,841	26,328.17 29,197,946	1.03
30	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	2,671	8,818.59 23,554,458	10,603.90 28,323,027	1.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 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	79.37%
ハイブリッド優先証券	17.46%
投資証券	1.10%
合計	97.93%

(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	4.54%
素材	1.75%
資本財・サービス	6.55%
一般消費財・サービス	5.99%
生活必需品	6.16%
ヘルスケア	12.09%
金融	10.28%
情報技術	19.49%
コミュニケーション・サービス	9.64%
公益事業	2.89%
合計	79.37%

(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（2020年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,262,364,861	97.59
内 イギリス	251,131,225	19.41
内 オランダ	151,284,122	11.69
内 フランス	227,560,586	17.59
内 ドイツ	223,108,898	17.25
内 スイス	267,967,823	20.72
内 スペイン	29,666,425	2.29
内 イタリア	102,973,989	7.96
内 フィンランド	8,671,793	0.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	31,219,630	2.41

純資産総額	1,293,584,491	100.00
-------	---------------	--------

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

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

## (2) 投資資産 (2020年1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	11,928.56 69,877,553	12,115.26 70,971,242	5.49
2	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	9,662.49 45,181,831	11,050.75 51,673,344	3.99
3	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	3,798	13,112.70 49,802,035	13,233.00 50,258,934	3.89
4	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	317,502.81 43,815,388	363,840.45 50,209,982	3.88
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	32,413.85 42,559,390	36,788.93 48,303,874	3.73
6	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,034	43,402.17 44,877,847	45,707.80 47,261,873	3.65
7	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	815.51 39,269,430	972.98 46,852,214	3.62
8	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	9,667.92 42,432,506	10,373.10 45,527,571	3.52
9	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	8,394	4,733.20 39,730,510	5,103.72 42,840,689	3.31
10	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,893	9,793.62 38,126,574	10,569.55 41,147,289	3.18
11	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,406.21 38,258,843	2,560.80 40,716,750	3.15
12	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,239	28,896.06 35,802,218	32,336.64 40,065,097	3.10
13	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	11,931.35 33,407,791	13,682.92 38,312,182	2.96

14	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーショ ン・サー ビス	21,145	1,864.16 39,417,849	1,765.76 37,337,067	2.89
15	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	867.64 37,659,459	804.35 34,912,359	2.70
16	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネル ギー	11,761	3,271.00 38,470,332	2,911.69 34,244,393	2.65
17	TOTAL SA	フラン ス	株式	エネル ギー	6,299	5,514.55 34,736,163	5,403.87 34,039,015	2.63
18	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	25,347.21 29,022,555	26,279.53 30,090,068	2.33
19	ENAGAS SA	スペイ ン	株式	公益事 業	10,115	2,491.41 25,200,642	2,932.91 29,666,425	2.29
20	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	1,832.02 27,195,462	1,955.17 29,022,632	2.24
21	ENI SPA	イタリア	株式	エネル ギー	18,265	1,653.40 30,199,409	1,554.99 28,402,035	2.20
22	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	100,555	262.25 26,370,951	275.66 27,719,740	2.14
23	MICHELIN (CGDE)	フラン ス	株式	一般消 費財・ サービ ス	2,155	12,384.88 26,689,427	12,817.96 27,622,715	2.14
24	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	7,770.17 28,563,171	7,458.60 27,417,814	2.12
25	KONINKLIJKE KPN NV	オラン ダ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	87,929	352.47 30,993,126	306.52 26,952,384	2.08
26	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・ サービ ス	6,823	3,580.12 24,427,213	3,848.39 26,257,613	2.03
27	CAPGEMINI SE	フラン ス	株式	情報技 術	1,883	13,028.49 24,532,647	13,672.09 25,744,555	1.99
28	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必 需品	5,047	3,881.77 19,591,333	4,785.43 24,152,068	1.87
29	ALSTOM	フラン ス	株式	資本財・ サービ ス	4,147	4,565.38 18,932,652	5,755.15 23,866,615	1.84

30	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	7,808.67 23,394,784	7,886.86 23,629,057	1.83
----	--------------------------------	-----	----	------------	-------	------------------------	------------------------	------

(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	97.59%
合計	97.59%

(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	7.47%
素材	9.89%
資本財・サービス	10.83%
一般消費財・サービス	5.75%
生活必需品	8.71%
ヘルスケア	17.33%
金融	21.26%
情報技術	2.66%
コミュニケーション・サービス	6.58%
公益事業	7.11%
合計	97.59%

(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 (2020年1月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	703,619,357	98.57
内 韓国	133,701,202	18.73
内 中国	144,285,928	20.21
内 台湾	148,096,080	20.75
内 香港	50,935,997	7.14
内 シンガポール	41,654,227	5.84
内 オーストラリア	184,945,923	25.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,213,858	1.43
純資産総額	713,833,215	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	2,550,900	0.36
内 日本	2,550,900	0.36

(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 (2020年1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	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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	12,450	4,605.00 57,332,250	5,268.12 65,588,094	9.19
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	54,000	1,044.00 56,376,000	1,139.40 61,527,600	8.62
3	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	1,900	18,045.24 34,286,032	22,755.81 43,236,043	6.06
4	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	8,600	2,677.28 23,024,640	2,858.31 24,581,466	3.44
5	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	13,000	1,414.37 18,386,914	1,380.60 17,947,800	2.51
6	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	5,600	3,223.50 18,051,600	3,080.74 17,252,172	2.42

7	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,500	9,618.57 14,427,869	10,679.81 16,019,728	2.24
8	WOOLWORTHS GROUP LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	4,800	2,731.51 13,111,288	3,037.13 14,578,260	2.04
9	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	16,000	932.25 14,916,096	906.98 14,511,744	2.03
10	CHAILEASE HOLDING CO LTD	台湾	株式	金融	31,000	478.24 14,825,596	462.60 14,340,600	2.01
11	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	181,000	75.24 13,618,440	79.20 14,335,200	2.01
12	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	2,250	5,795.04 13,038,841	6,261.89 14,089,270	1.97
13	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	12,800	1,092.25 13,980,888	1,099.33 14,071,450	1.97
14	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	台湾	株式	生活必需品	13,000	1,040.40 13,525,200	1,074.60 13,969,800	1.96
15	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	7,300	2,078.50 15,173,082	1,896.74 13,846,240	1.94
16	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	6,500	2,092.73 13,602,774	2,059.08 13,384,046	1.87
17	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポール	株式	コミュニケーション・サービス	49,400	253.17 12,507,052	270.00 13,338,217	1.87
18	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,000	2,906.68 11,626,726	3,333.96 13,335,848	1.87
19	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	110,000	104.94 11,543,400	112.32 12,355,200	1.73
20	BGF RETAIL CO LTD	韓国	株式	生活必需品	761	18,005.55 13,702,224	15,749.10 11,985,065	1.68
21	COCHLEAR LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	600	15,282.43 9,169,458	17,465.73 10,479,444	1.47
22	WILMAR INTERNATIONAL LTD	シンガポール	株式	生活必需品	29,000	349.72 10,143,446	314.87 9,131,276	1.28

23	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	中国	株式	不動産	18,500	450.68 8,337,654	466.12 8,623,368	1.21
24	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	60,000	129.22 7,753,633	143.20 8,592,480	1.20
25	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	28,900	257.24 7,434,464	282.89 8,175,793	1.15
26	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	中国	株式	素材	11,000	700.34 7,703,792	716.04 7,876,440	1.10
27	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国	株式	金融	29,000	262.26 7,605,749	269.00 7,801,186	1.09
28	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	1,900	3,941.88 7,489,572	4,033.98 7,664,562	1.07
29	WIWYNN CORP	台湾	株式	情報技術	3,000	1,989.55 5,968,652	2,458.80 7,376,400	1.03
30	SANDS CHINA LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	14,000	512.46 7,174,440	525.09 7,351,344	1.03

(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	98.57%
合計	98.57%

(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	1.61%
素材	5.39%
資本財・サービス	4.50%
一般消費財・サービス	9.68%
生活必需品	9.20%
ヘルスケア	7.52%
金融	23.14%

情報技術	22.83%
コミュニケーション・サービス	6.84%
公益事業	1.99%
不動産	5.87%
合計	98.57%

(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

(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	シンガポール・ドル売/ 円買 2020年2月	売建	10,000	800,911	801,000	0.11%
		韓国ウォン売/円買 2020 年2月	売建	19,000,000	1,746,100	1,749,900	0.25%

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

(注2) 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。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

##### (1) 投資状況 (2020年1月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	16,410,548,680	97.42
内 日本	16,410,548,680	97.42
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	433,962,266	2.58
純資産総額	16,844,510,946	100.00

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

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

##### (2) 投資資産 (2020年1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	武田薬品	日本	株式	医薬品	110,000	3,786.00 416,460,000	4,227.00 464,970,000	2.76
2	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	160,900	2,709.00 435,878,100	2,786.50 448,347,850	2.66
3	東京海上HD	日本	株式	保険業	69,600	5,676.00 395,049,600	5,985.00 416,556,000	2.47
4	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	52,200	7,385.00 385,497,000	7,652.00 399,434,400	2.37
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	664,700	543.20 361,065,040	568.50 377,881,950	2.24
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	89,300	3,721.00 332,285,300	3,884.00 346,841,200	2.06
7	Zホールディングス	日本	株式	情報・通 信業	786,400	333.00 261,871,200	438.00 344,443,200	2.04
8	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	95,000	2,970.00 282,150,000	3,271.00 310,745,000	1.84
9	オリックス	日本	株式	その他 金融業	135,000	1,660.00 224,100,000	1,858.00 250,830,000	1.49
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	88,300	2,694.50 237,924,350	2,823.00 249,270,900	1.48
11	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	50,000	4,373.00 218,650,000	4,913.00 245,650,000	1.46
12	第一工業製薬	日本	株式	化学	49,500	3,185.00 157,657,500	4,815.00 238,342,500	1.41
13	三井物産	日本	株式	卸売業	119,000	1,774.50 211,165,500	1,960.50 233,299,500	1.39
14	ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	149,200	1,489.95 222,300,562	1,496.00 223,203,200	1.33
15	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	211,700	1,059.00 224,190,300	1,049.00 222,073,300	1.32
16	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	77,600	2,899.50 225,001,200	2,831.00 219,685,600	1.30
17	IHI	日本	株式	機械	79,900	2,715.06 216,933,894	2,629.00 210,057,100	1.25
18	三洋貿易	日本	株式	卸売業	149,200	1,060.00 158,152,000	1,370.00 204,404,000	1.21

19	MS & AD	日本	株式	保険業	55,000	3,429.00 188,595,000	3,657.00 201,135,000	1.19
20	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	33,900	5,110.00 173,229,000	5,870.00 198,993,000	1.18
21	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	7,800	21,805.00 170,079,000	24,500.00 191,100,000	1.13
22	三井住友トラストHD	日本	株式	銀行業	45,100	3,797.00 171,244,700	4,083.00 184,143,300	1.09
23	デンソー	日本	株式	輸送用機器	39,400	4,861.00 191,523,400	4,542.00 178,954,800	1.06
24	SBIホールディングス	日本	株式	証券、商品先物取引業	65,000	2,292.00 148,980,000	2,578.00 167,570,000	0.99
25	豊田自動織機	日本	株式	輸送用機器	26,700	6,230.00 166,341,000	6,000.00 160,200,000	0.95
26	ニチアス	日本	株式	ガラス・土石製品	59,500	1,983.00 117,988,500	2,653.00 157,853,500	0.94
27	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	66,800	2,395.50 160,019,400	2,316.00 154,708,800	0.92
28	村田製作所	日本	株式	電気機器	24,000	5,794.00 139,056,000	6,328.00 151,872,000	0.90
29	東京建物	日本	株式	不動産業	85,000	1,520.00 129,200,000	1,780.00 151,300,000	0.90
30	セイコーHD	日本	株式	精密機器	55,900	2,597.77 145,215,672	2,697.00 150,762,300	0.90

(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	97.42%
合計	97.42%

(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	0.46%
建設業	4.32%
食料品	1.45%
繊維製品	0.59%

化学	10.31%
医薬品	5.33%
石油・石炭製品	0.77%
ゴム製品	0.69%
ガラス・土石製品	1.93%
鉄鋼	0.72%
非鉄金属	2.11%
金属製品	3.13%
機械	5.83%
電気機器	8.80%
輸送用機器	6.96%
精密機器	1.21%
その他製品	1.61%
陸運業	1.89%
情報・通信業	9.46%
卸売業	10.61%
小売業	1.01%
銀行業	6.34%
証券、商品先物取引業	0.99%
保険業	4.55%
その他金融業	2.36%
不動産業	1.78%
サービス業	2.22%
合計	97.42%

(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)

2020年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	17,800円
純資産総額	50億円



※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	第14期
	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	20年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	764	24.4%	日本円	50.6%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.3%	
国内債券	271	24.4%	米ドル	26.5%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.3%	
外国リート等	124	15.8%	ユーロ	12.2%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.3%	
国内リート・先物	51	14.8%	英ポンド	3.7%	残存年数	日本電信電話	日本	0.3%	
国内株式	154	9.5%	豪ドル	2.2%	債券格付別構成	東京海上HD	日本	0.2%	
外国株式	174	8.3%	カナダドル	1.3%	AAA	85.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.1%
			シンガポール・ドル	1.3%	AA	5.8%	野村不動産マスターF	日本	1.0%
			香港ドル	0.6%	A	6.5%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.5%	BBB	0.3%	日本ビルファンド	日本	0.9%
コール・ローン、その他	3.0%		その他	1.3%	BB以下・無格付	2.2%	GLP投資法人	日本	0.7%
合計	1,538	-	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2.2%保有しております。

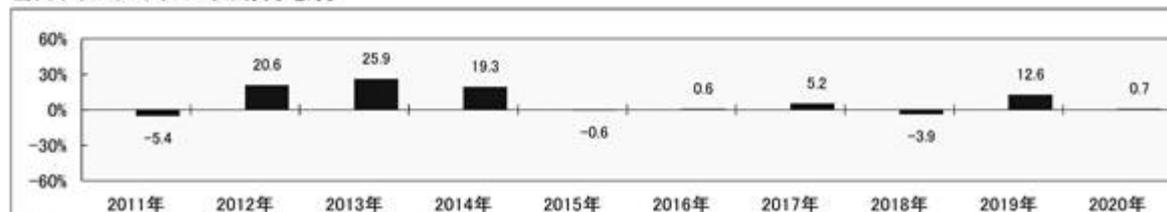
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンド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。

・2020年は1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】(2020年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

親投資信託受益証券		5,848,667,179	99.11
	内 日本	5,848,667,179	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		52,345,014	0.89
純資産総額		5,901,012,193	100.00

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

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

(2) 【投資資産】(2020年1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・REITアクティブ・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	293,188,451	3.2570 954,930,743	3.3807 991,182,196	16.80
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	336,609,370	2.8783 968,868,034	2.9132 980,610,416	16.62
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	343,746,813	2.7651 950,505,985	2.8380 975,553,455	16.53
4	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	746,260,565	1.2991 969,489,402	1.3071 975,437,184	16.53
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	343,524,595	2.8846 990,960,079	2.7944 959,945,128	16.27
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	227,766,376	3.1017 706,468,940	3.1052 707,260,150	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	127,703,579	1.7517 223,705,174	1.7138 218,858,393	3.71
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	19,953,028	2.1056 42,014,888	1.9957 39,820,257	0.67

(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	99.11%
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。

## 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
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	-
8月末日	5,093,725,906	-	1.7732	-
9月末日	5,271,498,276	-	1.8206	-
10月末日	5,495,588,199	-	1.8712	-
11月末日	5,608,427,295	-	1.8818	-
12月末日	5,765,803,343	-	1.8933	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
2020年1月末日	5,901,012,193	-	1.9013	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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

第14計算期間	14.7
---------	------

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第14計算期間	853,612,726	397,196,903

## (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)

2020年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	19,013円
純資産総額	59億円



※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	第14期
	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	20年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	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	124	18.3%	日本円	50.7%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.5%	
国内リート・先物	51	16.5%	米ドル	28.0%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%	
外国債券	764	16.3%	ユーロ	10.2%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.4%	
国内債券	271	16.3%	英ポンド	3.6%	残存年数	日本電信電話	日本	0.4%	
国内株式	154	15.8%	豪ドル	2.3%	債券格付別構成	東京海上HD	日本	0.4%	
外国株式	174	13.8%	シンガポール・ドル	1.4%	AAA	85.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.2%
			カナダ・ドル	1.3%	AA	5.8%	野村不動産マスターF	日本	1.1%
			スイス・フラン	0.8%	A	6.5%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.0%
			香港ドル	0.7%	BBB	0.3%	日本ビルファンド	日本	0.9%
コール・ローン、その他	3.2%		その他	1.1%	BB以下・無格付	2.2%	GLP投資法人	日本	0.8%
合計	1,538	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.3%	

※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2.2%保有しております。

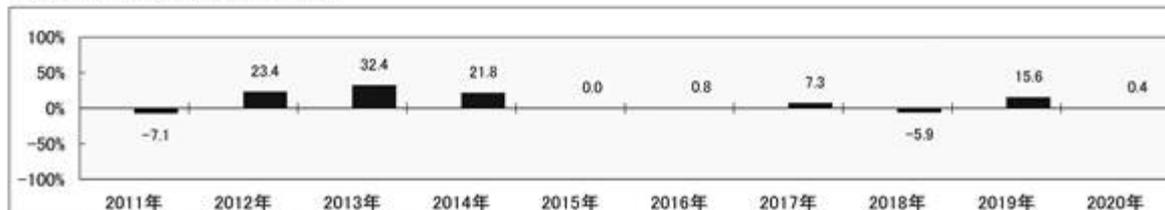
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンド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。

・2020年は1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】(2020年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	6,347,212,322	99.11
内 日本	6,347,212,322	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	56,699,379	0.89
純資産総額	6,403,911,701	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】 (2020年1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	558,186,352	2.8853 1,610,590,311	2.7944 1,559,795,942	24.36
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	383,061,106	3.2571 1,247,674,627	3.3807 1,295,014,681	20.22
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	449,901,706	2.7651 1,244,023,211	2.8380 1,276,821,041	19.94
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	371,763,700	3.1017 1,153,129,622	3.1052 1,154,400,641	18.03
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	208,666,972	1.7518 365,552,054	1.7138 357,613,456	5.58
6	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	109,780,620	2.8782 315,974,232	2.9132 319,812,902	4.99
7	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	243,875,399	1.2991 316,824,185	1.3071 318,769,534	4.98
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	32,562,071	2.1061 68,580,796	1.9957 64,984,125	1.01

(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	99.11%
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。

## 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
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	-
8月末日	5,522,799,007	-	1.8613	-
9月末日	5,739,816,004	-	1.9312	-
10月末日	6,068,561,360	-	2.0025	-
11月末日	6,197,782,097	-	2.0214	-
12月末日	6,304,804,389	-	2.0420	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
2020年1月末日	6,403,911,701	-	2.0451	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第14計算期間	18.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第14計算期間	898,116,398	365,651,278

(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)

2020年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	20,451円
純資産総額	64億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	0.2%
3か月間	2.1%
6か月間	8.4%
1年間	14.0%
3年間	21.9%
5年間	24.6%
設定来	104.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第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	第14期
	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	20年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	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	154	23.7%	日本円	50.7%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.8%	
外国リート等	124	22.8%	米ドル	30.0%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%	
外国株式	174	20.8%	ユーロ	7.3%	修正デュレーション	武田薬品	日本	0.7%	
国内リート・先物	51	19.8%	英ポンド	3.6%	残存年数	日本電信電話	日本	0.6%	
外国債券	764	4.9%	豪ドル	2.5%	債券格付別構成	東京海上HD	日本	0.6%	
国内債券	271	4.9%	シンガポール・ドル	1.6%	AAA	85.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.5%
			カナダ・ドル	1.4%	AA	5.8%	野村不動産マスターF	日本	1.3%
			スイス・フラン	1.2%	A	6.5%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.2%
			香港ドル	0.9%	BBB	0.3%	日本ビルファンド	日本	1.1%
コール・ローン、その他	3.4%		その他	0.9%	BB以下・無格付	2.2%	GLP投資法人	日本	0.9%
合計	1,538	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.4%	

※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2.2%保有しております。

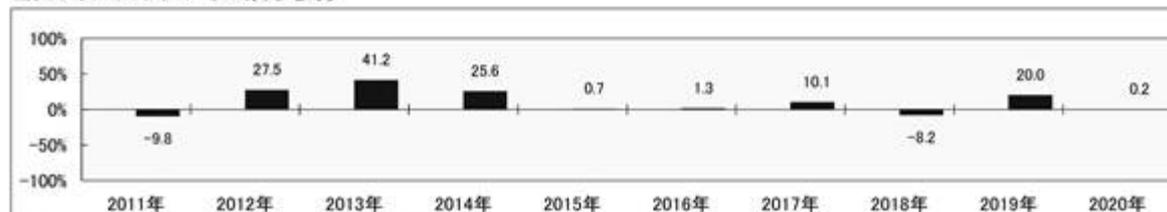
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2020年は1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け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約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、前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 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 1.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 3.または前 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14期計算期間(2019年1月11日から2020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】

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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	50,946,537	74,937,153
親投資信託受益証券	3,565,147,273	4,881,516,489
未収入金	-	1,627,000
流動資産合計	3,616,093,810	4,958,080,642
<b>資産合計</b>		
3,616,093,810		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,621,480	9,772,291
未払受託者報酬	960,415	1,259,547
未払委託者報酬	16,327,565	21,413,042
その他未払費用	145,104	190,310
流動負債合計	19,054,564	32,635,190
<b>負債合計</b>		
19,054,564		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,288,972,489	1 2,794,039,123
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,308,066,757	2,131,406,329
（分配準備積立金）	553,024,537	809,610,553
元本等合計	3,597,039,246	4,925,445,452
<b>純資産合計</b>		
3,597,039,246		
<b>負債純資産合計</b>		
3,616,093,810		

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 自 2018年1月11日 至 2019年1月10日	第14期 自 2019年1月11日 至 2020年1月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	6	86
有価証券売買等損益	112,997,368	515,590,216
その他収益	-	12,290
<b>営業収益合計</b>	<b>112,997,362</b>	<b>515,602,592</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	26,413	28,796
受託者報酬	1,822,149	2,310,362
委託者報酬	1 30,977,668	1 39,277,784
その他費用	278,041	348,477
<b>営業費用合計</b>	<b>33,104,271</b>	<b>41,965,419</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>146,101,633</b>	<b>473,637,173</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>146,101,633</b>	<b>473,637,173</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>146,101,633</b>	<b>473,637,173</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（ ）	6,869,978	30,783,675
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>1,245,240,440</b>	<b>1,308,066,757</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>350,010,460</b>	<b>558,472,976</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	350,010,460	558,472,976
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>147,952,488</b>	<b>177,986,902</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	147,952,488	177,986,902
<b>分配金</b>	<b>2 -</b>	<b>2 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>1,308,066,757</b>	<b>2,131,406,329</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14期	
	自 2019年1月11日	至 2020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13期	第14期
	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首元本額	1,945,585,227円	2,288,972,489円
期中追加設定元本額	575,990,631円	809,239,523円
期中一部解約元本額	232,603,369円	304,172,889円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,288,972,489口	2,794,039,123口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 2018年1月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2020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	4,071,543円	5,187,830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(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>	<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(319,449,859円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,469,707,616円)及び分配準備積立金(490,160,694円)より分配可能額は2,279,318,169円(1万口当たり8,157.79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14期 自 2019年1月11日 至 2020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14期 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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	110,645,825	498,085,750
合計	110,645,825	498,085,750

## (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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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14期 自 2019年1月11日 至 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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)	1.5715円 (15,715円)	1.7628円 (17,628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	423,869,091	1,219,895,243	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	937,929,543	1,218,464,269	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	265,291,377	733,557,186	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	168,401,560	486,276,344	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	116,753,865	362,147,138	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	64,007,562	112,154,050	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	10,299,043	21,692,874	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	223,340,105	727,329,385	
親投資信託受益証券 合計			4,881,516,489	
合計			4,881,516,489	

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

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	230,509,218	979,808,502
コール・ローン	1,205,691,831	1,651,905,787
国債証券	162,968,622,856	189,735,396,998
派生商品評価勘定	3,416,203	8,389,024
未収利息	1,312,237,478	1,364,622,870
前払費用	36,746,058	49,815,516
流動資産合計	165,757,223,644	193,789,938,697
資産合計	165,757,223,644	193,789,938,697
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,406,259	716,267
未払金	135,423,318	715,810,978
未払解約金	50,222,913	49,890,878
その他未払費用	22,676	-
流動負債合計	198,075,166	766,418,123
負債合計	198,075,166	766,418,123
純資産の部		
元本等		
元本	1 61,542,450,975	67,069,648,143
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金( )	104,016,697,503	125,953,872,431
元本等合計	165,559,148,478	193,023,520,574
純資産合計	165,559,148,478	193,023,520,574
負債純資産合計	165,757,223,644	193,789,938,697

## 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 2020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	<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1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	59,579,655,477円	61,542,450,975円
期中追加設定元本額	6,343,591,932円	9,548,012,549円
期中一部解約元本額	4,380,796,434円	4,020,815,381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	690,564,508円	650,299,726円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	24,922,245円	22,093,366円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	160,549,057円	124,735,116円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	47,279,215円	42,191,319円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	524,647,964円	428,004,948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)	2,265,111円	38,583,061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)	364,027,868円	451,731,396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)	1,133,977,935円	1,546,708,676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)	700,379,471円	795,050,364円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	701,020円	2,503,662円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,109円	505,722円
i F r e e 外国債券イン デックス	512,803,907円	614,937,192円
i F r e e 8資産バランス	496,933,707円	816,870,082円
i F r e e 年金バランス	4,558,433円	15,278,264円
D Cダイワ外国債券インデッ クス	42,686,055,745円	45,822,888,977円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	735,766,293円	791,449,867円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	367,685,013円	416,869,610円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	233,087,436円	261,532,079円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	328,126,532円	423,869,091円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	261,594,952円	331,858,792円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	82,438,806円	108,639,633円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	10,434,826円	9,489,359円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	17,776,818円	20,637,601円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,838,407円	3,581,906円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	3,640,463円	77,238,656円
ダイワつみたてインデックス バランス30	- 円	735,776円
ダイワつみたてインデックス バランス50	- 円	61,308円

ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	217,968円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	223,220,528円	199,765,495円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	149,818,145円	152,054,653円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,560,870,986円	4,894,427,212円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	15,278,574円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	7,772,191円	- 円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	325,032,492円	280,209,141円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,218,648円	144,395,781円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	28,863,937円	33,400,825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)	27,703,290円	1,683,601,854円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,556,510,701円	5,748,578,972円
ダイワライフスタイル25	35,109,364円	34,955,853円
ダイワライフスタイル50	58,680,101円	62,515,800円
ダイワライフスタイル75	17,289,177円	17,179,040円
計	61,542,450,975円	67,069,648,143円
2. 期末日における受益権の総数	61,542,450,975口	67,069,648,143口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資すること、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020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)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年1月10日現在	2020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	2,144,596,306	1,460,304,757

合計	2,144,596,306	1,460,304,757
----	---------------	---------------

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年12月1日から2019年1月10日まで、及び2019年12月3日から2020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	2019年1月10日 現在				2020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	1,102,187,666	-	1,093,197,610	8,990,056	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757
アメリカ・ドル	381,194,717	-	376,240,600	4,954,117	608,468,766	-	611,164,260	2,695,494
イギリス・ポンド	67,018,499	-	66,655,780	362,719	43,636,685	-	43,645,500	8,815
オーストラリア・ドル	19,413,731	-	19,365,000	48,731	6,864,138	-	6,759,000	105,138
カナダ・ドル	53,692,487	-	54,010,310	317,823	23,443,239	-	23,533,750	90,511
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	42,314,983	-	42,168,600	146,383
ポーランド・ズロチ	27,780,426	-	27,646,530	133,896	28,244,515	-	28,238,070	6,445
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	51,349,185	-	51,586,500	237,315
ユーロ	502,544,645	-	499,000,000	3,544,645	700,991,421	-	706,346,800	5,355,379
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	41,054,791	-	40,598,000	456,791

合計	1,102,187,666	-	1,093,197,610	8,990,056	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757
----	---------------	---	---------------	-----------	---------------	---	---------------	-----------

## (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1月10日現在	2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	2.6902円	2.8780円
(1万口当たり純資産額)	(26,902円)	(28,780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 20210215	アメリカ・ドル 4,076,000.000	アメリカ・ドル 4,164,653.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,602,020.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,554,069.280	

2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,169,298.210	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,251,436.240	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,468,491.740	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,545,975.310	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	8,168,000.000	8,174,697.760	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,402,635.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,706,551.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,706,456.080	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,230,074.440	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,020,563.560	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,458,553.100	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,655,877.330	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,741,577.580	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,842,467.810	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,087,751.360	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,971,521.120	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,746,397.640	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,511,137.500	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,350,401.300	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	759,660.240	

6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,067,741.100	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	823,920.300	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	935,880.000	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	905,457.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	944,580.960	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	994,572.720	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,363,230.960	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,091,000.000	1,474,213.750	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,826,000.000	2,438,696.040	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,065,640.320	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	735,514.640	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	707,578.650	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,511,864.540	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,489,349.390	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,453,684.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,636,234.600	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,010,000.000	2,804,733.900	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,275,250.540	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	2,025,279.360	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,963,862.030	

4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,498,344.980	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,856,604.750	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,867,000.000	2,339,873.760	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,660,583.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,858,708.290	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,520,744.940	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,407,561.340	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,836,481.300	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,826,000.000	3,238,172.100	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,898,000.000	4,292,048.820	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,795,744.480	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,523,805.680	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,117,000.000	5,110,514.440	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,371,541.230	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,862,340.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,358,875.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,929,000.000	4,515,246.090	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,309,274.360	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,656,718.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,177,686.770	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,082,880.140	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,329,442.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,901,555.540	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,201,672.390	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,422,825.560	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,834,485.990	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	4,063,000.000	4,190,253.160	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,815,639.030	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,901,841.250	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,915,914.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,324,230.950	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,621,795.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,845,414.620	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,858,462.880	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,201,639.810	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,834,945.430	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	4,073,000.000	4,495,573.750	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,463,337.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,482,802.640	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,013,331.200	

3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,189,686.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,577,773.340	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,358,671.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,046,895.040	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,068,427.520	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,118,059.960	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,332,838.120	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,572,780.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,928,000.000	4,051,339.200	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,290,370.330	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,249,341.860	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,988,971.320	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,116,524.850	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,976,282.500	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,443,091.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,071,117.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,532,091.010	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,691,981.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,500,375.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,482,800.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,977,260.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,314,356.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,421,814.400	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,671,066.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,672,250.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,745,444.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,379,360.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,482,480.050	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,017,025.180	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	6,500,000.000	6,598,995.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,981,700.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,500,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,718,500.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,536,289.100	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,410,064.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,031,840.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,559,175.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,511,040.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,027,157.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,539,272.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,028,821.600	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,028,090.100	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,345,080.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	7,550,000.000	7,697,451.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,918,560.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,936,436.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,978,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,019,440.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,043,590.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,011,700.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	8,800,000.000	8,931,296.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,012,630.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,436,168.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,095,408.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,921,054.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,062,340.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	4,125,052.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,202,976.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,019,840.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,519,525.000	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,553,125.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,527,925.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,683,040.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,801,315.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,595,690.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,269,248.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,878,288.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,309,062.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,580,640.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,748,371.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,517,075.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,403,125.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,705,612.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,843,208.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	4,098,924.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,228,352.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,981,548.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,037,054.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,522,925.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	4,895,268.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,033,195.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,040,170.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,591,600.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,014,874.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,766,585.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,593,350.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,072,050.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,585,150.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,165,450.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,349,863.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	4,550,000.000	4,726,631.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,258,445.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,788,630.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,544,625.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,656,250.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,742,020.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,802,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,565,730.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,676,550.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,134,760.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,065,970.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,678,300.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,182,480.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,092,640.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	8,068,179.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,800,000.000	5,863,104.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,194,520.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	5,000,000.000	5,232,400.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,854,796.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	4,000,000.000	4,033,560.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,680,180.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,594,725.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,053,550.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,033,620.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,055,890.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,027,510.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,134,360.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,629,100.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	5,254,764.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,029,400.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,611,900.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,396,162.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,559,745.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,576,150.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,754,168.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,441,820.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,850,000.000	5,413,424.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	6,900,000.000	7,213,191.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,586,940.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,906,512.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,000,000.000	2,013,500.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,514,595.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,069,120.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,515,015.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,700,000.000	4,700,893.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,031,240.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,016,080.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,709,729.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,515,015.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,000,000.000	2,015,300.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	6,762,483.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,492,475.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,850,000.000	4,767,356.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,094,544.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,733,276.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,928,720.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	2,993,070.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,091,024.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,478,500.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,978,430.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,882,890.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	4,000,000.000	3,971,240.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,545,512.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	4,500,000.000	4,459,905.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,300,000.000	5,249,862.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	3,400,000.000	3,432,402.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,497,480.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,981,560.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,978,880.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,002,910.000	

アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 836,687,337.100 (91,675,831,526)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,964,003.130	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,498,698.520	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,450,505.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,546,541.900	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,317,007.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,590,000.000	1,663,140.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,650,000.000	1,791,075.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	1,755,677.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,573,133.100	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,010,920.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,687,650.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,093,959.000	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,900,000.000	1,930,799.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	570,000.000	631,446.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	940,406.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,700,000.000	1,708,806.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	700,000.000	699,188.000		
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,216,090.060		

6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,379,741.610	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,854,828.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,798,533.760	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,967,939.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,557,000.000	2,494,781.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,205,062.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,480,908.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,570,861.600	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,946,000.000	3,189,494.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,870,113.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,640,882.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,209,343.400	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,483,922.500	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,510,000.000	2,213,056.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,594,524.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,442,930.700	
3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	844,876.450	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,584,856.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,312,488.480	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,893,846.200	

	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,058,811.300	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,641,000.000	3,028,301.400	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,528,736.160	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,118,032.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 86,245,914.970 (12,351,277,483)	
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	2,579,042.400	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,428,055.720	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,380,847.040	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,251,628.660	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,668,762.680	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,712,222.720	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,020,060.260	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,738,367.300	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,148,000.000	3,768,156.000	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,479,911.580	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	807,000.000	948,507.450	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	942,000.000	1,187,438.100	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	2,995,365.440	

	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,678,000.000	2,907,424.260	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,555,059.120	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,841,310.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,163,552.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,614,263.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,400,000.000	2,736,168.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,770,000.000	3,104,117.400	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	390,000.000	458,624.400	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,140,000.000	1,165,570.200	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 49,704,453.730 (3,736,283,787)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	475,000.000	631,379.500	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	843,927.900	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,332,662.930	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,227,000.000	1,828,033.680	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,660,838.720	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,914,047.270	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	976,343.680	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,796,455.960	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,136,166.060	

1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,248,175.950	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,458,516.450	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,297,000.000	1,600,627.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,194,945.640	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,369,000.000	1,360,484.820	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,817,307.360	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,443,990.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,187,386.800	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,405,929.600	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,721,545.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,236,408.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	2,100,000.000	2,108,001.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,013,380.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	890,000.000	954,293.600	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,288,625.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,231,740.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	301,680.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,050,787.500	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,393,910.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	398,956.000	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	550,000.000	530,931.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	794,368.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	600,000.000	590,070.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	2,200,000.000	2,194,170.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 43,646,086.020 (3,660,597,234)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	868,114.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,615.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	663,426.470	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	396,946.300	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	500,346.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	453,000.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	699,047.800	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	718,000.000	849,925.320	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	325,000.000	357,019.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	546,008.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	780,205.760	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	257,950.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	458,339.400	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	502,900.000	

	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	315,150.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	453,555.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	589,325.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	499,153.200	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	161,298.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 9,808,324.250 (795,455,098)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	スウェーデン・クローナ 6,399,572.550	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,237,261.950	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,559,545.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,388,259.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,085,154.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,817,312.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	4,700,000.000	4,973,399.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 46,460,504.750 (536,618,830)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,462,000.000	デンマーク・クローネ 23,351,046.360	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,061,437.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,232,226.200	

	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,513,000.000	7,361,057.730	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,428,510.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	4,373,396.100	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	819,968.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 57,627,641.390 (938,178,002)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	7,224,455.280	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,314,272.760	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,366,703.250	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,459,097.600	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,367,922.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,534,697.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,662,470.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,344,087.500	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 34,273,706.290 (423,280,273)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,554,308.160	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,449,774.350	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,142,952.500	

	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,063,600.630	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,925,850.200	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,353,616.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,913,127.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,570,000.000	2,634,943.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,040,000.000	2,124,394.800	
	Poland Government Bond 20210525	800,000.000	784,928.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	1,900,000.000	1,926,429.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,080,062.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,684,000.000	1,808,279.200	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,836,811.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,852,822.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,751,149.710	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 38,203,050.500 (1,094,899,427)	
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	581,635.110	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	845,283.060	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,288,932.260	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,949,779.080	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,613,712.040	

4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,392,898.000	
3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	883,172.500	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	759,216.600	
4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	656,853.660	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,012,971.960	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,475,960.370	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,224,426.400	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	699,654.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,102,429.860	
4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	872,066.060	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	766,008.320	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,182,710.700	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	887,445.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,332,037.140	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,040,372.400	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	675,317.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	356,012.800	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	900,000.000	916,200.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	778,800.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	926,748.100	

	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,208,382.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,239,948.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	816,208.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	784,497.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	704,016.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	674,843.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	910,000.000	954,999.500	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,100,000.000	1,285,834.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	405,124.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	800,000.000	829,616.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 34,124,110.420 (914,526,160)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	15,290,000.000	14,490,485.900	
	8% Mexican Bonos 20471107	13,300,000.000	14,675,087.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	13,000,000.000	13,108,680.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	14,300,000.000	15,001,987.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	4,992,350.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	22,033,000.000	22,931,065.080	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	27,134,670.360	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	27,501,046.040	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,476,034.280	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	21,044,000.000	23,417,131.880	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	13,594,000.000	15,571,519.180	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	26,326,000.000	26,236,228.340	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,880,237.200	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	24,458,293.720	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	19,926,202.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	9,944,000.000	10,665,039.440	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 285,466,058.220 (1,661,412,458)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	444,230.280	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	297,701.370	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	430,378.650	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,588.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	400,000.000	486,896.000	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	780,048.500	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	314,685.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	414,932.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	524,595.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	524,255.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	203,678.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	949,020.840	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,200,608.760	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	634,000.000	778,754.880	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	200,000.000	254,244.000	
	Austria Government Bond 20230715	900,000.000	915,804.000	
	0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	608,454.800	
	2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	876,997.800	

Austria Government Bond 20220920	400,000.000	406,072.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,068,820.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,200,000.000	1,256,544.000	
Austria Government Bond 20240715	300,000.000	305,388.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,483,149.850	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,274,000.000	1,392,673.100	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	933,219.280	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,384,126.060	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,126,343.040	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	540,000.000	750,195.000	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	502,235.300	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,496,586.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,092,903.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	637,711.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	345,282.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,640,000.000	1,756,997.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	619,498.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,200,000.000	1,297,248.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	727,596.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,241,557.800	

6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,078,250.100	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,019,301.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,792,712.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,574,694.330	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,362,774.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,975,000.000	3,357,006.250	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,459,067.040	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,206,274.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,599,000.000	3,099,229.770	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,306,946.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,406,092.890	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,769,702.580	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,481,788.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	2,954,199.080	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,352,542.500	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,438,000.000	3,761,102.600	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,736,179.080	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,502,087.100	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,944,825.950	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,748,554.470	

1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,709,248.170	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,609,000.000	4,109,801.160	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,736,407.960	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,650,880.620	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,306,574.140	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,311,655.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,294,242.640	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,928,004.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,900,000.000	1,987,115.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,452,628.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,209,935.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,602,630.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	1,991,029.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,400,000.000	2,513,208.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,941,021.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	362,508.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	402,832.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,849.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	505,040.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	809,264.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,589,835.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,414,742.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,175,810.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,134,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	744,008.700	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,940,679.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	2,250,000.000	2,301,142.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,741,004.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,580,936.700	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,134,993.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,578,091.660	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,776,868.390	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,396,364.010	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,664,000.000	3,198,624.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,411,429.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,265,705.600	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,840,892.290	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,284,000.000	5,836,357.640	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,342,834.190	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,894,842.380	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,437,014.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,929,257.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,536,786.510	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,906,556.600	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,538,000.000	4,010,141.520	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,605,555.750	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,451,752.720	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,109,240.440	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,755,385.150	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,441,753.080	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,336,117.820	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,092,635.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,913,274.290	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,341,104.770	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,037,000.000	1,311,514.640	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,792,437.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,300,000.000	3,400,683.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,054,480.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,870,000.000	2,280,689.400	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,712,800.000	

2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,919,937.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,441,088.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,382,900.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,415,816.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,450,000.000	2,763,330.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,950,000.000	3,153,933.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,464,396.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,416,408.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	2,910,450.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,500,000.000	2,612,950.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	2,700,000.000	2,747,277.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	1,800,000.000	1,789,488.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	682,994.320	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,810,897.620	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,557,446.300	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	895,016.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,713,305.850	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,548,541.610	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,541,794.840	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,540,977.440	

1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,497,655.900	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,549,000.000	2,525,489.600	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,683,628.560	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,336,972.510	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,411,121.700	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,214,136.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,290,444.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,427,776.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,242,299.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,100,000.000	1,137,268.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	417,216.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,466,279.500	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,569,451.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,358,942.080	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,977,078.600	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,629,000.000	1,930,104.360	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,676,436.480	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,755,795.860	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,788,192.100	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,021,951.750	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,557,286.720	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,555,228.800	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,411,723.650	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,868,388.180	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,688,898.600	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,124,000.000	1,181,256.560	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	2,068,000.000	2,113,558.040	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,569,235.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,368,443.020	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,013,573.440	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,856,315.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,635,103.500	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,375,387.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,282,375.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,772,480.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,822,570.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,734,408.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,900,000.000	1,977,178.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,478,139.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,500,000.000	2,675,550.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	919,737.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,349,335.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,504,965.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,758,583.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,506,946.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,800,000.000	1,972,908.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,249,752.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,197,370.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,622,587.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,585,309.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,193,835.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	1,200,000.000	1,263,324.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,300,000.000	1,396,941.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	700,000.000	805,273.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,400,000.000	1,397,676.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	736,300.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	700,000.000	688,604.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	300,000.000	297,369.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,745,963.260	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,188,086.980	

5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	2,055,000.000	3,035,646.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,520,706.180	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,601,862.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,898,996.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,968,887.420	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,603,529.110	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,580,444.120	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,984,026.230	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,524,054.500	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,241,702.080	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,461,860.490	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,226,962.080	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,892,294.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,710,000.000	3,115,416.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,115,720.300	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,156,186.420	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,345,027.790	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,555,417.620	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,818,147.240	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,519,220.580	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,328,797.700	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,660,224.600	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,491,391.220	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,859,329.040	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	966,743.410	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,860,263.360	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,566,712.080	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,298,016.720	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,489,619.880	
4% Belgium Government Bond 20320328	980,000.000	1,429,898.400	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,466,822.640	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	953,000.000	1,613,009.680	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,707,377.350	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,026,983.070	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,465,131.330	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	1,004,000.000	1,144,389.320	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	704,120.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	1,061,000.000	1,305,889.410	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	530,375.760	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,003,670.910	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,154,204.640	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	654,164.500	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,564.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	538,090.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	784,630.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	224,924.000	

1.1% IRISH TREASURY 20290515	700,000.000	766,913.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	463,324.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,225,455.000	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,429,226.260	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,084,512.040	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,154,020.000	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	874,197.420	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	971,434.160	
3.8% Austria Government Bond 20620126	388,000.000	816,623.600	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,003,223.130	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,040,562.950	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,003,934.520	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,023,205.520	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	827,933.760	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	482,789.970	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	482,857.920	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	330,348.720	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	475,699.140	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	600,813.400	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	584,518.550	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,530,540.160	

1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,445,000.000	2,652,360.450	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,355,613.920	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,457,034.720	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,933,438.780	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,779,267.090	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,552,000.000	2,113,606.720	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,150,000.000	1,822,347.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,187,061.100	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,116,732.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,500,000.000	2,733,700.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,850,000.000	2,237,353.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,238,620.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,306,734.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,634,544.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,600,000.000	1,743,104.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,721,343.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,427,538.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,070,183.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,713,294.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,079,246.000	

1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,100,000.000	1,257,091.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	900,000.000	913,698.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,200,000.000	2,232,164.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,208,414.170	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,825,922.420	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,708,000.000	2,926,162.680	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,019,022.340	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,167,804.900	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,747,457.680	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,708,705.300	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,702,051.850	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,231,935.640	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,060,357.600	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,231,869.050	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,503,948.200	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,396,473.140	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,301,511.600	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,381,499.990	
ユーロ 小計		ユーロ 582,051,950.560 (70,829,901,863)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド

	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	21,934,000.000	24,515,631.800	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,312,682.440	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,625,235.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,194,512.800	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,460,153.900	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,439,000.000	8,575,543.020	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	22,552,000.000	19,699,172.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,751,270.590	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	16,862,000.000	15,730,053.940	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	12,644,000.000	11,074,753.160	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,859,280.820	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,166,000.000	9,470,848.920	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	9,679,000.000	8,813,310.240	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 145,082,449.030 (1,117,134,857)	
国債証券	合計		189,735,396.998 [189,735,396,998]	
合計			189,735,396.998 [189,735,396,998]	

- (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 243銘柄	100%	48.3%

イギリス・ポンド	国債証券	42銘柄	100%	6.5%
オーストラリア・ドル	国債証券	22銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	100%	1.9%
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	7銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	8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	35銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	303銘柄	100%	37.3%
南アフリカ・ランド	国債証券	13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

	2019年1月10日現在	2020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	25,896,593	64,849,132
国債証券	14,084,673,690	17,604,320,010
地方債証券	936,314,000	1,458,385,200
特殊債券	918,622,200	729,970,300
社債券	1,043,178,800	935,292,900
未収入金	86,746,610	-
未収利息	32,947,023	34,898,734
前払費用	318,250	1,287,679
流動資産合計	17,128,697,166	20,829,003,955
資産合計	17,128,697,166	20,829,003,955
負債の部		

流動負債		
未払解約金	23,618,648	6,121,900
その他未払費用	3,279	-
流動負債合計	23,621,927	6,121,900
負債合計	23,621,927	6,121,900
純資産の部		
元本等		
元本	1 13,344,778,620	16,028,287,542
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,760,296,619	4,794,594,513
元本等合計	17,105,075,239	20,822,882,055
純資産合計	17,105,075,239	20,822,882,055
負債純資産合計	17,128,697,166	20,829,003,955

## 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 2020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	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	12,192,600,488円	13,344,778,620円
期中追加設定元本額	2,484,162,074円	3,594,110,341円
期中一部解約元本額	1,331,983,942円	910,601,419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）	13,050,515円	143,275,232円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	59,366円	1,116,709円
i F r e e 日本債券イン デックス	115,479,282円	136,404,966円
i F r e e 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,077,056,677円	1,806,325,099円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	5,829,421,442円	6,367,336,202円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,175,753,849円	3,685,725,233円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,003,199,495円	1,155,900,772円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	709,974,615円	937,929,543円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	565,614,868円	732,725,273円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	178,625,800円	240,167,951円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	56,096,348円	52,496,870円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	48,034,174円	62,292,873円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,068,294円	9,940,560円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	14,157,915円	169,662,829円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	- 円	5,962,153円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	- 円	541,071円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	- 円	957,554円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	341,397,807円	316,908,449円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	192,516,134円	202,618,203円

ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	8,170,599円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	11,101,440円	- 円
計	13,344,778,620円	16,028,287,542円
2. 期末日における受益権の総数	13,344,778,620口	16,028,287,542口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	109,901,630	58,561,970
地方債証券	1,568,200	2,008,300
特殊債券	745,400	204,700
社債券	1,329,500	296,700
合計	113,544,730	56,645,670

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年12月1日から2019年1月10日まで、及び2019年12月3日から2020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

2019年1月10日現在	2020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)

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	1.2818円	1.2991円
(1万口当たり純資産額)	(12,818円)	(12,991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 9 8 2年国債	100,000,000	100,259,000	
	4 0 1 2年国債	70,000,000	70,231,700	
	4 0 3 2年国債	160,000,000	160,593,600	
	4 0 6 2年国債	180,000,000	180,793,800	
	1 2 7 5年国債	140,000,000	140,387,800	

1 2 8	5年国債	227,000,000	227,778,610	
1 2 9	5年国債	182,000,000	182,751,660	
1 3 0	5年国債	217,000,000	218,028,580	
1 3 1	5年国債	190,000,000	190,995,600	
1 3 2	5年国債	170,000,000	170,994,500	
1 3 3	5年国債	200,000,000	201,318,000	
1 3 4	5年国債	170,000,000	171,200,200	
1 3 5	5年国債	230,000,000	231,725,000	
1 3 6	5年国債	140,000,000	141,132,600	
1 3 7	5年国債	170,000,000	171,445,000	
1 3 8	5年国債	240,000,000	242,179,200	
1 3 9	5年国債	200,000,000	201,890,000	
1 4 0	5年国債	200,000,000	201,914,000	
1 4 1	5年国債	170,000,000	171,679,600	
1	40年国債	30,000,000	45,832,500	
2	40年国債	23,000,000	34,174,320	
3	40年国債	19,000,000	28,477,580	
4	40年国債	30,000,000	45,346,200	
5	40年国債	35,000,000	51,256,800	
6	40年国債	28,000,000	40,479,880	
7	40年国債	31,000,000	43,182,070	
8	40年国債	23,000,000	30,000,280	
9	40年国債	40,000,000	39,134,000	
1 0	40年国債	91,000,000	104,374,270	
1 1	40年国債	85,000,000	94,692,550	
1 2	40年国債	80,000,000	80,660,000	
3 1 3	10年国債	34,000,000	34,573,580	
3 1 4	10年国債	77,000,000	78,117,270	
3 1 5	10年国債	90,000,000	91,720,800	
3 1 6	10年国債	56,000,000	56,990,640	
3 1 7	10年国債	40,000,000	40,836,000	
3 1 8	10年国債	33,000,000	33,634,260	
3 1 9	10年国債	140,000,000	143,361,400	
3 2 0	10年国債	35,000,000	35,772,450	
3 2 1	10年国債	65,000,000	66,611,350	
3 2 2	10年国債	140,000,000	143,164,000	
3 2 3	10年国債	70,000,000	71,766,100	
3 2 4	10年国債	80,000,000	81,823,200	
3 2 5	10年国債	160,000,000	164,025,600	

3 2 6	1 0 年国債	20,000,000	20,491,400	
3 2 7	1 0 年国債	90,000,000	92,475,900	
3 2 8	1 0 年国債	60,000,000	61,397,400	
3 2 9	1 0 年国債	160,000,000	165,126,400	
3 3 0	1 0 年国債	81,000,000	83,771,010	
3 3 1	1 0 年国債	130,000,000	133,485,300	
3 3 2	1 0 年国債	65,000,000	66,874,600	
3 3 3	1 0 年国債	83,000,000	85,527,350	
3 3 4	1 0 年国債	220,000,000	227,053,200	
3 3 5	1 0 年国債	210,000,000	216,079,500	
3 3 7	1 0 年国債	50,000,000	51,029,000	
3 3 8	1 0 年国債	100,000,000	102,682,000	
3 3 9	1 0 年国債	25,000,000	25,703,500	
3 4 0	1 0 年国債	160,000,000	164,665,600	
3 4 1	1 0 年国債	15,000,000	15,367,050	
3 4 3	1 0 年国債	92,000,000	93,220,840	
3 4 4	1 0 年国債	85,000,000	86,143,250	
3 4 5	1 0 年国債	280,000,000	283,906,000	
3 4 6	1 0 年国債	100,000,000	101,409,000	
3 4 7	1 0 年国債	180,000,000	182,557,800	
3 4 8	1 0 年国債	170,000,000	172,431,000	
3 4 9	1 0 年国債	200,000,000	202,872,000	
3 5 0	1 0 年国債	185,000,000	187,586,300	
3 5 1	1 0 年国債	160,000,000	162,168,000	
3 5 2	1 0 年国債	200,000,000	202,616,000	
3 5 3	1 0 年国債	161,000,000	163,018,940	
3 5 4	1 0 年国債	110,000,000	111,315,600	
3 5 5	1 0 年国債	30,000,000	30,339,900	
3 5 6	1 0 年国債	218,000,000	220,323,880	
2	3 0 年国債	9,000,000	11,181,870	
3	3 0 年国債	4,000,000	4,946,640	
4	3 0 年国債	8,000,000	10,488,560	
5	3 0 年国債	8,000,000	9,951,520	
6	3 0 年国債	9,000,000	11,484,540	
7	3 0 年国債	12,000,000	15,275,160	
1 0	3 0 年国債	15,000,000	16,962,000	
1 1	3 0 年国債	9,000,000	10,908,270	
1 2	3 0 年国債	11,000,000	13,959,990	
1 3	3 0 年国債	11,000,000	13,843,060	

14	30年国債	22,000,000	29,012,940	
15	30年国債	21,000,000	28,069,440	
16	30年国債	26,000,000	34,852,480	
17	30年国債	17,000,000	22,619,180	
18	30年国債	20,000,000	26,400,800	
19	30年国債	15,000,000	19,863,600	
20	30年国債	16,000,000	21,744,320	
21	30年国債	16,000,000	21,302,720	
22	30年国債	17,000,000	23,236,450	
23	30年国債	16,000,000	21,941,120	
24	30年国債	15,000,000	20,619,450	
25	30年国債	17,000,000	22,884,040	
26	30年国債	32,000,000	43,727,680	
27	30年国債	32,000,000	44,493,440	
28	30年国債	34,000,000	47,549,680	
29	30年国債	43,000,000	59,660,350	
30	30年国債	56,000,000	77,079,520	
31	30年国債	76,000,000	103,703,520	
32	30年国債	59,000,000	82,075,490	
33	30年国債	75,000,000	100,415,250	
34	30年国債	70,000,000	97,063,400	
35	30年国債	68,000,000	91,907,440	
36	30年国債	64,000,000	86,895,360	
37	30年国債	87,000,000	116,809,680	
38	30年国債	45,000,000	59,627,700	
39	30年国債	50,000,000	67,513,000	
40	30年国債	44,000,000	58,528,360	
41	30年国債	34,000,000	44,528,780	
42	30年国債	53,000,000	69,569,920	
43	30年国債	37,000,000	48,624,290	
44	30年国債	42,000,000	55,321,560	
45	30年国債	43,000,000	54,652,140	
46	30年国債	55,000,000	69,958,900	
47	30年国債	44,000,000	57,109,800	
48	30年国債	50,000,000	62,518,000	
49	30年国債	68,000,000	85,176,800	
50	30年国債	60,000,000	66,236,400	
51	30年国債	55,000,000	53,813,650	
52	30年国債	57,000,000	58,585,740	

5 3	3 0 年国債	55,000,000	57,885,300
5 4	3 0 年国債	55,000,000	60,690,300
5 5	3 0 年国債	56,000,000	61,842,480
5 6	3 0 年国債	50,000,000	55,190,500
5 7	3 0 年国債	50,000,000	55,163,000
5 8	3 0 年国債	55,000,000	60,647,950
5 9	3 0 年国債	55,000,000	59,211,900
6 0	3 0 年国債	122,000,000	137,872,200
6 1	3 0 年国債	50,000,000	53,750,000
6 2	3 0 年国債	46,000,000	46,895,160
6 3	3 0 年国債	50,000,000	49,608,000
6 4	3 0 年国債	50,000,000	49,539,500
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,105,960
5 0	2 0 年国債	30,000,000	30,723,600
5 1	2 0 年国債	25,000,000	25,768,000
5 2	2 0 年国債	19,000,000	19,720,290
5 3	2 0 年国債	13,000,000	13,565,240
5 4	2 0 年国債	14,000,000	14,635,880
5 5	2 0 年国債	41,000,000	42,914,290
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,624,600
5 7	2 0 年国債	24,000,000	25,190,640
5 8	2 0 年国債	35,000,000	36,917,300
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,162,000
6 1	2 0 年国債	40,000,000	41,442,400
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,512,640
6 3	2 0 年国債	30,000,000	31,994,700
6 4	2 0 年国債	35,000,000	37,621,500
6 5	2 0 年国債	42,000,000	45,360,000
6 6	2 0 年国債	30,000,000	32,281,500
6 7	2 0 年国債	19,000,000	20,611,580
6 8	2 0 年国債	25,000,000	27,435,250
6 9	2 0 年国債	12,000,000	13,118,640
7 0	2 0 年国債	18,000,000	20,015,640
7 1	2 0 年国債	17,000,000	18,752,360
7 2	2 0 年国債	53,000,000	58,512,530
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,611,260
7 6	2 0 年国債	25,000,000	27,616,750
7 8	2 0 年国債	17,000,000	18,866,600
7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,613,640

8 1	2 0 年国債	65,000,000	72,820,800	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	31,529,120	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	35,250,410	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,897,300	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	38,137,770	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	17,238,300	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	51,891,750	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	20,725,380	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	52,138,800	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	35,363,100	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	26,767,630	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	29,417,250	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	39,744,300	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	62,222,530	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	41,534,850	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	21,656,880	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	12,079,200	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	25,188,450	
1 0 4	2 0 年国債	64,000,000	75,680,640	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	45,104,480	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	19,130,720	
1 0 7	2 0 年国債	20,000,000	23,836,200	
1 0 8	2 0 年国債	68,000,000	79,824,520	
1 0 9	2 0 年国債	60,000,000	70,657,200	
1 1 0	2 0 年国債	27,000,000	32,292,810	
1 1 1	2 0 年国債	35,000,000	42,340,900	
1 1 2	2 0 年国債	40,000,000	48,011,600	
1 1 3	2 0 年国債	70,000,000	84,314,300	
1 1 4	2 0 年国債	45,000,000	54,412,200	
1 1 5	2 0 年国債	42,000,000	51,201,780	
1 1 6	2 0 年国債	27,000,000	33,028,830	
1 1 7	2 0 年国債	77,000,000	93,410,240	
1 1 8	2 0 年国債	13,000,000	15,687,230	
1 1 9	2 0 年国債	23,000,000	27,275,240	
1 2 0	2 0 年国債	75,000,000	87,378,750	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	51,472,680	
1 2 4	2 0 年国債	45,000,000	54,658,800	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	31,009,250	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	25,580,310	

1 2 7	2 0 年国債	53,000,000	63,969,940	
1 2 8	2 0 年国債	32,000,000	38,750,080	
1 2 9	2 0 年国債	65,000,000	77,972,050	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	33,671,400	
1 3 1	2 0 年国債	70,000,000	83,365,800	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	29,857,000	
1 3 3	2 0 年国債	57,000,000	68,749,410	
1 3 4	2 0 年国債	15,000,000	18,144,450	
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	23,950,800	
1 3 6	2 0 年国債	65,000,000	77,054,900	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	21,602,160	
1 3 9	2 0 年国債	92,000,000	109,277,600	
1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	57,915,360	
1 4 2	2 0 年国債	100,000,000	121,936,000	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	57,401,760	
1 4 4	2 0 年国債	60,000,000	70,971,600	
1 4 5	2 0 年国債	100,000,000	121,203,000	
1 4 6	2 0 年国債	86,000,000	104,502,040	
1 4 7	2 0 年国債	89,000,000	107,122,180	
1 4 8	2 0 年国債	74,000,000	88,236,120	
1 4 9	2 0 年国債	100,000,000	119,405,000	
1 5 0	2 0 年国債	95,000,000	112,219,700	
1 5 1	2 0 年国債	104,000,000	120,034,720	
1 5 2	2 0 年国債	100,000,000	115,496,000	
1 5 3	2 0 年国債	100,000,000	117,166,000	
1 5 4	2 0 年国債	87,000,000	100,764,270	
1 5 5	2 0 年国債	93,000,000	104,890,980	
1 5 6	2 0 年国債	106,000,000	109,493,760	
1 5 7	2 0 年国債	93,000,000	93,000,000	
1 5 8	2 0 年国債	95,000,000	99,520,100	
1 5 9	2 0 年国債	82,000,000	87,228,320	
1 6 0	2 0 年国債	80,000,000	86,427,200	
1 6 1	2 0 年国債	80,000,000	85,031,200	
1 6 2	2 0 年国債	110,000,000	116,815,600	
1 6 3	2 0 年国債	72,000,000	76,455,360	
1 6 4	2 0 年国債	125,000,000	130,432,500	
1 6 5	2 0 年国債	95,000,000	99,096,400	
1 6 6	2 0 年国債	80,000,000	86,271,200	
1 6 7	2 0 年国債	70,000,000	72,899,400	

	168 20年国債	55,000,000	56,201,200	
	169 20年国債	80,000,000	80,220,800	
	170 20年国債	30,000,000	30,055,800	
国債証券 合計			17,604,320,010	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	102,124,900	
	27-15 北海道公債	100,000,000	101,046,700	
	222 神奈川県公債	100,000,000	100,173,400	
	401 大阪府公債	100,000,000	102,570,200	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	102,860,600	
	11 兵庫県公債20年	100,000,000	117,662,200	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	100,303,100	
	24-16 愛知県公債	100,000,000	102,317,600	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	101,302,100	
	116 共同発行地方	100,000,000	102,299,100	
	117 共同発行地方	100,000,000	102,119,500	
	168 共同発行地方	100,000,000	101,063,400	
	25-6 大阪市公債	100,000,000	102,661,400	
	11 名古屋市20年	100,000,000	119,881,000	
地方債証券 合計			1,458,385,200	
特殊債券	81 政保道路機構	100,000,000	118,852,200	
	190 政保道路機構	100,000,000	102,087,000	
	241 政保道路機構	100,000,000	102,289,900	
	261 政保道路機構	100,000,000	102,162,900	
	36 地方公共団体	100,000,000	102,121,200	
	65 地方公共団体	100,000,000	102,502,600	
	11789 利付商工債	100,000,000	99,954,500	
特殊債券 合計			729,970,300	
社債券	20 成田国際空港	100,000,000	100,232,900	
	33 中日本高速道	100,000,000	101,835,200	
	25 西日本高速道	100,000,000	102,301,600	
	17 パナソニック	100,000,000	100,941,800	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	101,715,400	
	44 野村ホールディング	100,000,000	100,623,400	
	80 三菱地所	100,000,000	114,394,900	
	32 東日本旅客鉄道	100,000,000	109,104,700	
	497 関西電力	100,000,000	104,143,000	
社債券 合計			935,292,900	
合計			20,727,968,410	

## 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

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,544,587,759	1,087,698,334
コール・ローン	459,739,031	476,910,969
投資証券	85,452,798,470	89,388,682,897
派生商品評価勘定	1,027,640	-
未収入金	640,139,392	1,037,881,420
未収配当金	375,219,862	287,547,853
流動資産合計	89,473,512,154	92,278,721,473
資産合計	89,473,512,154	92,278,721,473
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	35,981	689,728
未払金	509,998,361	351,405,923
未払解約金	90,000,000	224,078,000
その他未払費用	10,865	-
流動負債合計	600,045,207	576,173,651
負債合計	600,045,207	576,173,651
純資産の部		
元本等		
元本	1 40,758,891,506	33,163,733,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	48,114,575,441	58,538,814,666
元本等合計	88,873,466,947	91,702,547,822
純資産合計	88,873,466,947	91,702,547,822
負債純資産合計	89,473,512,154	92,278,721,473

## 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 2020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	<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>

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1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	49,411,771,560円	40,758,891,506円
期中追加設定元本額	241,325,768円	201,703,741円
期中一部解約元本額	8,894,205,822円	7,796,862,091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）	36,671,794,648円	29,514,785,392円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	32,937,857円	27,600,624円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,940,110円	14,473,027円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,895,462円	12,969,327円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	84,706,741円	66,444,416円
6資産バランスファンド（分配型）	153,611,646円	121,337,152円
6資産バランスファンド（成長型）	345,054,843円	290,956,882円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,595,047,787円	1,382,735,184円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	46,338,729円	38,159,377円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	4,310,926円	3,382,852円

常陽3分法ファンド	221,126,129円	168,809,724円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	52,169,101円	39,619,502円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	238,786,268円	265,291,377円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	317,016,351円	345,957,189円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	393,487,604円	454,017,584円
ダイワ・グローバルREITファンド（ダイワSMA専用）	50,327,337円	19,380,214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）	457,522,556円	349,465,022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）	26,695,146円	21,643,551円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	33,122,265円	26,704,760円
計	40,758,891,506円	33,163,733,156円
2. 期末日における受益権の総数	40,758,891,506口	33,163,733,156口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	4,182,635,453	2,280,869,414
合計	4,182,635,453	2,280,869,414

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年9月19日から2019年1月10日まで、及び2019年9月18日から2020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	2019年1月10日 現在				2020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	293,648,445	-	292,620,805	1,027,640	370,612,279	-	371,272,279	660,000
アメリカ・ドル	217,384,000	-	216,360,000	1,024,000	218,420,000	-	219,080,000	660,000
イギリス・ポンド	50,385,062	-	50,381,422	3,640	-	-	-	-
ユーロ	25,879,383	-	25,879,383	0	152,192,279	-	152,192,279	0
買 建	76,264,445	-	76,228,464	35,981	152,192,279	-	152,162,551	29,728
アメリカ・ドル	76,264,445	-	76,228,464	35,981	152,192,279	-	152,162,551	29,728
合計	369,912,890	-	368,849,269	991,659	522,804,558	-	523,434,830	689,728

## (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1月10日現在	2020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)	2.1805円 (21,805円)	2.7651円 (27,651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			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	238,116	6,136,249.320	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	125,276	18,068,557.480	
		BOSTON PROPERTIES INC	30,413	4,092,373.280	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	241,899	12,344,105.970	
		EQUINIX INC	53,493	31,506,842.070	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	312,114	8,561,287.020	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	443,643	7,732,697.490	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	298,984	10,694,657.680	
		CYRUSONE INC	64,837	4,248,120.240	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	273,302	8,166,263.760	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	356,213	8,474,307.270	
		INVITATION HOMES INC	480,383	14,329,824.890	
		VICI PROPERTIES INC	673,625	17,076,393.750	
		VEREIT INC	1,363,816	12,547,107.200	
		PROLOGIS INC	303,487	26,998,203.520	
		COUSINS PROPERTIES INC	167,208	6,736,810.320	
		SITE CENTERS CORP	442,920	5,598,508.800	
		DUKE REALTY CORP	421,449	14,510,489.070	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	90,240	27,023,270.400	
		WELLTOWER INC	302,480	24,942,500.800	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	145,010	5,028,946.800	
		KILROY REALTY CORP	135,123	10,934,153.160	
MACERICH CO/THE	247,713	6,252,276.120			
REALTY INCOME CORP	225,780	16,538,385.000			
PUBLIC STORAGE	64,997	13,915,207.730			
REGENCY CENTERS CORP	168,018	10,341,507.900			
UDR INC	727,354	33,210,983.640			
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14,020	586,176.200			

	DIGITAL REALTY TRUST INC	140,352	16,662,589.440	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	176,226	18,658,808.880	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	391,823	8,259,628.840	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 410,177,234.040 (44,943,119,533)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	7,225,528	5,476,950.220	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,839,088	17,725,130.140	
	SEGREO PLC	1,460,860	12,738,699.200	
	UNITE GROUP PLC/THE	521,662	6,489,475.280	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	402,892	3,417,329.940	
	DERWENT LONDON PLC	166,097	6,474,461.060	
	WORKSPACE GROUP PLC	206,330	2,376,921.600	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	579,767	4,484,497.740	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,112,972	9,336,446.440	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 68,519,911.620 (9,812,736,543)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	NATIONAL STORAGE REIT	10,838,103	21,080,110.330	
	MIRVAC GROUP	10,322,741	33,548,908.250	
	GOODMAN GROUP	2,822,331	39,625,527.240	
	CHARTER HALL GROUP	1,741,018	20,718,114.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	4,364,462	19,989,235.960	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 134,961,895.980 (10,145,085,721)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	397,407	18,642,362.370	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	412,199	21,768,229.190	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 40,410,591.560 (3,389,236,314)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	13,031,141	28,668,510.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	5,346,760	16,361,085.600	

	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	7,595,977	25,446,522.950	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	6,500,035	17,745,095.550	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 88,221,214.300 (7,154,740,480)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	7,659,508	17,080,702.840	ニュージーランド・ドル
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 17,080,702.840 (1,236,472,079)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	339,172	5,694,697.880	ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,292	2,312,805.000	
	NSI NV	54,103	2,372,416.550	
	ARGAN	49,925	3,944,075.000	
	GECINA SA	72,529	11,843,985.700	
	KLEPIERRE	560,928	18,628,418.880	
	COVIVIO	36,942	3,768,084.000	
	AEDIFICA	79,081	8,904,520.600	
	BEFIMMO	63,289	3,354,317.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	429,240	10,100,017.200	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	23,083	1,174,924.700	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	330,614	3,735,938.200	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	598,825	7,515,253.750	
ユーロ 小計			ユーロ 83,349,454.460 (10,142,795,113)	
香港・ドル	LINK REIT	2,232,805	181,750,327.000	香港・ドル
香港・ドル 小計			香港・ドル 181,750,327.000 (2,564,497,114)	
投資証券 合計			89,388,682,897 [89,388,682,897]	
合計			89,388,682,897 [89,388,682,897]	

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 31銘柄	100%	50.3%
イギリス・ポンド	投資証券 9銘柄	100%	11.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 5銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.8%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	8.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.4%
ユーロ	投資証券 13銘柄	100%	11.3%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	2.9%

### 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

	2019年1月10日現在	2020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	336,338,173	1,990,247,834
投資証券	2 102,721,473,160	111,334,726,250
未収入金	591,772,740	1,525,032,576
未収配当金	1,022,947,360	873,164,339
前払金	-	38,493,600
流動資産合計	104,672,531,433	115,761,664,599
資産合計	104,672,531,433	115,761,664,599
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	34,995,120

未払金		351,319,798	525,356,141
未払解約金		63,797,000	51,932,000
その他未払費用		7,878	-
流動負債合計		415,124,676	612,283,261
負債合計		415,124,676	612,283,261
純資産の部			
元本等			
元本	1	40,074,865,523	35,358,466,590
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,182,541,234	79,790,914,748
元本等合計		104,257,406,757	115,149,381,338
純資産合計		104,257,406,757	115,149,381,338
負債純資産合計		104,672,531,433	115,761,664,599

## 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 2020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、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	受取配当金

原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	39,732,652,426円	40,074,865,523円
期中追加設定元本額	3,894,385,063円	4,247,554,247円
期中一部解約元本額	3,552,171,966円	8,963,953,180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）	16,324,252円	12,326,378円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,928,918円	10,602,515円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	75,145,191円	54,126,491円
6資産バランスファンド（分配型）	138,161,686円	101,070,889円
6資産バランスファンド（成長型）	310,377,097円	237,160,019円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	42,981,217円	31,708,419円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	1,772,953円	1,384,668円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	45,346,969円	33,022,502円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	209,009,628円	223,340,105円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	277,551,866円	291,080,539円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	354,113,582円	380,661,232円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	354,050,748円	346,345,424円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	37,250,828,134円	32,902,728,027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)	98,597,464円	72,408,222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)	33,674,499円	25,369,900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)	162,026,929円	118,696,450円
	ダイワ・アクティブリート・ファンド(年4回決算型)	689,974,390円	516,434,810円
計		40,074,865,523円	35,358,466,590円
2.	期末日における受益権の総数	40,074,865,523口	35,358,466,590口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券		先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 722,000,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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)における不動産投信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。 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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	229,401,786	1,282,023,811
合計	229,401,786	1,282,023,811

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年11月13日から2019年1月10日まで、及び2019年11月12日から2020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

## 不動産投信関連

種 類	2019年1月10日 現在			2020年1月10日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち			うち		

		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	-	-	-	-	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600
合計	-	-	-	-	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2019年1月10日現在	2020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)	2.6016円 (26,016円)	3.2566円 (32,566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	サンケイリアルエステート	6,350	799,465,000	
	SOSILA物流リート投	12,608	1,523,046,400	
	MCUBS MidCity投資法人	20,972	2,474,696,000	
	森ヒルズリート	21,796	3,857,892,000	
	産業ファンド	6,936	1,147,214,400	
	アドバンス・レジデンス	7,724	2,633,884,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,067	2,664,361,300	

A P I 投資法人	2,820	1,503,060,000	
G L P 投資法人	35,815	4,824,280,500	
コンフォリア・レジデンシャル	6,328	2,189,488,000	
日本プロロジスリート	3,253	907,912,300	
星野リゾート・リート	3,895	2,220,150,000	
イオンリート投資	4,459	666,620,500	
ヒューリックリート投資法	7,088	1,378,616,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	74,817	1,627,269,750	
積水ハウス・リート投資	39,028	3,508,617,200	
ケネディクス商業リート	6,864	1,854,652,800	
ヘルスケア&メディカル投資	3,260	445,316,000	
野村不動産マスターF	40,219	7,396,274,100	
ラサールロジポート投資	5,940	941,490,000	
スターアジア不動産投	3,090	360,603,000	
三井不動産パーク	4,447	2,141,230,500	
大江戸温泉リート	2,019	188,776,500	
さくら総合リート	1,061	101,007,200	
森トラスト・ホテルリート投	6,250	938,125,000	
三菱地所物流REIT	3,792	1,332,888,000	
CREロジスティクスファンド	7,812	1,098,367,200	
ザイマックス・リート	7,247	1,004,434,200	
伊藤忠アドバンスロジ	2,456	293,737,600	
日本ビルファンド	7,709	6,190,327,000	
ジャパンリアルエステイト	10,771	7,776,662,000	
日本リテールファンド	20,354	4,703,809,400	
オリックス不動産投資	16,020	3,779,118,000	
日本プライムリアルティ	2,210	1,047,540,000	
プレミア投資法人	7,833	1,186,699,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,036	966,746,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,632	1,759,201,600	
森トラスト総合リート	13,233	2,557,938,900	
インヴィンシブル投資法人	45,215	2,780,722,500	
フロンティア不動産投資	2,725	1,220,800,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,060	1,963,386,000	
福岡リート投資法人	9,821	1,810,992,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	6,214	5,145,192,000	
いちごオフィスリート投資法人	12,037	1,314,440,400	
大和証券オフィス投資法人	2,350	1,948,150,000	
スターツプロシード投資法人	2,699	542,229,100	
大和ハウスリート投資法人	24,654	6,890,793,000	

	ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,016	3,045,081,600	
	日本賃貸住宅投資法人	25,635	2,681,421,000	
投資証券	合計		111,334,726,250	
合計			111,334,726,250	

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) 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

ジャパンリアルエステイト 1,000口

## 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1月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	60,237,003	79,742,449
コール・ローン	81,824,449	40,491,484
株式	1,552,015,502	2,225,803,957
ハイブリッド優先証券	453,582,465	516,369,020
投資証券	42,682,171	31,258,784
未収入金	17,571,381	7,026,310
未収配当金	2,564,780	3,548,576
未収利息	1,446,368	559,087
流動資産合計	2,211,924,119	2,904,799,667
資産合計	2,211,924,119	2,904,799,667
負債の部		
流動負債		
未払金	18,997,392	37,843,613
未払解約金	1,255,000	6,550,000

その他未払費用		2,153	-
流動負債合計		20,254,545	44,393,613
負債合計		20,254,545	44,393,613
純資産の部			
元本等			
元本	1	889,650,063	922,190,111
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,302,019,511	1,938,215,943
元本等合計		2,191,669,574	2,860,406,054
純資産合計		2,191,669,574	2,860,406,054
負債純資産合計		2,211,924,119	2,904,799,667

## 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 2020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。</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>
<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>(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>
<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	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	835,469,909円	889,650,063円
期中追加設定元本額	136,219,368円	124,557,329円
期中一部解約元本額	82,039,214円	92,017,281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）	10,836,111円	8,728,464円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,024,161円	7,563,461円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	179,086,701円	140,259,669円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	31,733,446円	23,648,064円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	31,395,290円	23,593,216円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	103,673,048円	116,753,865円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	206,831,439円	227,747,249円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	316,069,867円	373,896,123円
計	889,650,063円	922,190,111円
2. 期末日における受益権の総数	889,650,063口	922,190,111口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	55,962,359	168,277,621
ハイブリッド優先証券	2,757,675	4,024,245
投資証券	399,894	292,299
合計	53,604,578	172,594,165

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年10月16日から2019年1月10日まで、及び2019年10月16日から2020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

2019年1月10日現在	2020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)

	2019年1月10日現在	2020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)	2.4635円 (24,635円)	3.1018円 (31,018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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABORATORIES	2,584	86.440	223,360.960	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,109	233.500	258,951.500	
	DOLLAR TREE INC	4,980	91.060	453,478.800	
	CELANESE CORP	667	117.860	78,612.620	
	DANAHER CORP	758	157.670	119,513.860	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,970	94.430	374,887.100	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,720	44.150	164,238.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	3,851	97.770	376,512.270	
	APPLE INC	3,367	309.630	1,042,524.210	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	7,151	58.850	420,836.350	
	JPMORGAN CHASE & CO	4,255	137.440	584,807.200	
CATERPILLAR INC	2,485	147.310	366,065.350		
CISCO SYSTEMS INC	7,709	47.320	364,789.880		

MORGAN STANLEY	2,776	52.060	144,518.560	
BROADCOM INC	1,289	306.260	394,769.140	
TELEFLEX INC	721	379.410	273,554.610	
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,788	69.860	334,489.680	
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,094	59.340	183,597.960	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,437	94.150	229,443.550	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	902	174.910	157,768.820	
AMAZON.COM INC	319	1,901.050	606,434.950	
EOG RESOURCES INC	3,103	88.250	273,839.750	
NEXTERA ENERGY INC	2,187	243.090	531,637.830	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	719	242.600	174,429.400	
ALPHABET INC-CL A	470	1,419.790	667,301.300	
HOME DEPOT INC	1,346	225.190	303,105.740	
HERSHEY CO/THE	1,707	146.570	250,194.990	
JOHNSON & JOHNSON	3,160	145.390	459,432.400	
PHILLIPS 66	1,557	105.620	164,450.340	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,138	168.690	191,969.220	
MERCK & CO. INC.	2,196	89.380	196,278.480	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,158	372.360	431,192.880	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,814	88.280	513,259.920	
XCEL ENERGY INC	2,665	62.540	166,669.100	
ACCENTURE PLC-CL A	929	206.150	191,513.350	
AT&T INC	10,864	38.800	421,523.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,570	131.330	206,188.100	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,713	116.930	317,231.090	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,702	144.330	245,649.660	
ANTHEM INC	1,902	306.410	582,791.820	
WALT DISNEY CO/THE	4,305	144.830	623,493.150	
WASTE MANAGEMENT INC	2,319	116.130	269,305.470	
WHIRLPOOL CORP	789	150.360	118,634.040	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,435	205.000	294,175.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,209	193.250	620,139.250	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	781	160.810	125,592.610	
TYSON FOODS INC-CL A	5,306	89.210	473,348.260	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	798	329.610	263,028.780	
BANK OF AMERICA CORP	11,401	35.030	399,377.030	

	AMERICAN EXPRESS CO	2,028	127.810	259,198.680	
	EATON CORP PLC	2,671	95.190	254,252.490	
	ECOLAB INC	575	190.040	109,273.000	
	INTEL CORP	6,486	59.300	384,619.800	
	MICROSOFT CORP	5,743	162.090	930,882.870	
	CVS HEALTH CORP	5,595	72.860	407,651.700	
	MEDTRONIC PLC	3,337	118.390	395,067.430	
	CHUBB LTD	1,950	153.950	300,202.500	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 19,670,056.000 (2,155,248,036)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	14,573	44.500	648,498.500	
	ENBRIDGE INC	3,699	52.110	192,754.890	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 841,253.390 (70,555,921)	
合計				2,225,803,957 [2,225,803,957]	

## (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	
		CHS INC 7.5 4	4,575.000	127,139.250	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4,200.000	108,696.420	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,100.000	28,649.500	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	2,929.000	76,593.350	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	2,175.000	57,072.000	
		BANK OF AMERICA CORP 6 EE	831.000	21,946.710	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4,550.000	118,391.000	
		LEGG MASON INC 5.45	3,350.000	87,100.000	
		ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	31,572.000	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	30,672.000	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	1,326.000	38,135.760	
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2,100.000	54,810.000			

NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	3,125.000	90,593.750	
VALLEY NATIONAL BANCORP FR B	2,076.000	56,321.880	
SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	52,084.160	
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.7	824.000	22,437.520	
ENBRIDGE INC FR B	916.000	25,244.960	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	5,875.000	162,267.500	
UNUM GROUP 6.25	3,350.000	92,091.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75 F	6,450.000	174,924.000	
KKR & CO INC 6.5 B	750.000	20,452.500	
KEYCORP 5.65 F	1,300.000	35,048.000	
DUKE ENERGY CORP 5.625	2,075.000	57,768.000	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	1,850.000	50,949.000	
NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	78,455.200	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2,450.000	69,751.500	
CMS ENERGY CORP 5.875	2,250.000	61,785.000	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	5,450.000	150,229.250	
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5,825.000	159,779.750	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.875	4,175.000	114,854.250	
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	5,243.000	147,328.300	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	3,172.000	90,306.840	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	3,709.000	105,966.130	
SPIRE INC 5.9 A	4,234.000	116,604.360	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	2,100.000	60,438.000	
VOYA FINANCIAL INC 5.35 B	3,400.000	92,922.000	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	6,050.000	162,684.500	
TCF FINANCIAL 5.7 C*	400.000	10,692.000	
ALLSTATE CORP 5.1 H	4,375.000	114,800.000	
SEMPRA ENERGY 5.75	2,828.000	74,687.480	
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1,923.000	53,651.700	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	4,700.000	122,012.000	
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	3,950.000	101,515.000	

		FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3,025.000	76,562.750	
		METLIFE INC 4.75 F	2,525.000	63,731.000	
		SOUTHERN CO 4.95 2020	6,100.000	153,720.000	
		DTE ENERGY CO 5.25	3,075.000	79,212.000	
		CITIGROUP INC 6.875 K	2,768.000	79,413.920	
		WELLS FARGO & COMPANY 6 T	850.000	21,675.000	
		ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1,963.000	51,391.340	
		PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,175.000	32,477.000	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	5,333.000	151,137.220	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 B	5,475.000	139,826.570	
		STATE STREET CORP 5.25 C	1,650.000	42,949.500	
		STATE STREET CORP 5.9 D	4,506.000	124,861.260	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	6,792.000	186,304.560	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 4,712,686.140 (516,369,020)	
ハイブリッド優先証券 合計				516,369,020 [516,369,020]	
投資証券	アメリカ・ドル	UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1,200	31,332.000	アメリカ・ドル
		MONMOUTH REIT 6.125 C	2,875	71,990.000	
		SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1,350	36,045.000	
		QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	32,230.250	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	3,189	87,633.720	
		TAUBMAN CENTERS INC 6.5 J	1,000	26,055.000	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 285,285.970 (31,258,784)	
投資証券 合計				31,258,784 [31,258,784]	
合計				547,627,804 [547,627,804]	

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 57銘柄 ハイブリッド 優先証券 56銘柄 投資証券 6銘柄	79.7%	19.1%	1.2%	97.5%
カナダ・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	-%	2.5%

## 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

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	55,778,969	22,071,420
コール・ローン	31,311,532	5,555,987
株式	1,058,521,362	1,291,689,972
未収配当金	2,026,765	1,583,281
流動資産合計	1,147,638,628	1,320,900,660
資産合計	1,147,638,628	1,320,900,660
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,000,000	394,000
その他未払費用	653	-

流動負債合計		1,000,653	394,000
負債合計		1,000,653	394,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	772,639,327	753,612,190
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		373,998,648	566,894,470
元本等合計		1,146,637,975	1,320,506,660
純資産合計		1,146,637,975	1,320,506,660
負債純資産合計		1,147,638,628	1,320,900,660

## 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 2020年1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  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	受取配当金

<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>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>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1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	779,893,882円	772,639,327円
期中追加設定元本額	74,639,626円	87,407,995円
期中一部解約元本額	81,894,181円	106,435,132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）	17,639,183円	15,220,471円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,232,681円	13,253,942円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	297,130,387円	245,943,189円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	53,456,345円	41,888,141円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	51,202,245円	41,523,055円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	55,581,567円	64,007,562円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	110,309,660円	125,547,416円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	171,087,259円	206,228,414円
計	772,639,327円	753,612,190円
2. 期末日における受益権の総数	772,639,327口	753,612,190口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	13,840,281	77,848,112
合計	13,840,281	77,848,112

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年10月16日から2019年1月10日まで、及び2019年10月16日から2020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

2019年1月10日現在	2020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)

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1口当たり純資産額	1.4841円	1.7522円
(1万口当たり純資産額)	(14,841円)	(17,522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	14.770	219,245.880	
	AVIVA PLC	40,669	4.177	169,874.410	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	17.902	284,641.800	
	M&G PLC	14,844	2.432	36,100.600	
	VODAFONE GROUP PLC	96,642	1.519	146,857.180	
	KINGFISHER PLC	30,751	2.175	66,883.420	
	NATIONAL GRID PLC	10,672	9.365	99,943.280	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,047	34.590	174,575.730		

	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	5.881	255,258.920	
	CARNIVAL PLC	3,111	35.420	110,191.620	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	22.605	265,857.400	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,829,430.240 (261,992,705)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,313	317.750	417,205.750	
	NESTLE SA-REG	5,858	103.080	603,842.640	
	ALCON INC	877	55.860	48,989.220	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,034	399.600	413,186.400	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	92.360	405,368.040	
	GIVAUDAN-REG	138	3,008.000	415,104.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 2,303,696.050 (259,280,990)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	118.400	331,520.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	74.360	222,782.560	
	BASF SE	3,676	66.310	243,755.560	
	ALLIANZ SE-REG	1,145	220.700	252,701.500	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	268.700	332,919.300	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	14.850	314,003.250	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,823	34.625	236,246.370	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,394	44.690	375,127.860	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	22.190	144,368.140	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,798	113.900	432,592.200	
	KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.673	235,034.210	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	7,197	16.785	120,801.640	
	TOTAL SA	6,299	49.960	314,698.040	
	MICHELIN (CGDE)	2,155	110.750	238,666.250	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	91.800	429,256.800	
	BNP PARIBAS	3,990	52.400	209,076.000	
	CAPGEMINI SE	1,883	109.050	205,341.150	
	ALSTOM	4,147	43.170	179,025.990	
	SANOFI	3,893	92.000	358,156.000	
	INTESA SANPAOLO	100,555	2.374	238,717.570	
	ENI SPA	18,265	14.140	258,267.100	

	ENEL SPA	48,153	7.305	351,757.660	
	ENAGAS SA	10,115	23.000	232,645.000	
	NOKIA OYJ	20,277	3.625	73,514.260	
ユーロ	小計			ユーロ 6,330,974.410 (770,416,277)	
合計				1,291,689,972 [1,291,689,972]	

## (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 11銘柄	100%	20.3%
スイス・フラン	株式 6銘柄	100%	20.1%
ユーロ	株式 24銘柄	100%	59.6%

## 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

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

	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	35,915,540	18,890,871
コール・ローン	12,370,388	3,982,785
株式	644,045,508	739,815,433

投資証券		23,537,942	7,810,464
未収配当金		176,695	2,014,119
流動資産合計		716,046,073	772,513,672
資産合計		716,046,073	772,513,672
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	2,533,000
その他未払費用		200	-
流動負債合計		200	2,533,000
負債合計		200	2,533,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	399,914,948	365,560,068
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		316,130,925	404,420,604
元本等合計		716,045,873	769,980,672
純資産合計		716,045,873	769,980,672
負債純資産合計		716,046,073	772,513,672

## 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 2020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。</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1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首 期首元本額	2018年1月11日 401,541,859円	2019年1月11日 399,914,948円

期中追加設定元本額	30,191,058円	29,964,452円
期中一部解約元本額	31,817,969円	64,319,332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）	15,154,627円	12,675,264円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,486,286円	11,045,001円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	238,136,163円	207,648,885円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	41,793,124円	35,324,845円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	39,223,517円	35,358,128円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	8,805,453円	10,299,043円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	17,430,598円	20,069,686円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	26,885,180円	33,139,216円
計	399,914,948円	365,560,068円
2. 期末日における受益権の総数	399,914,948口	365,560,068口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年1月11日 至 2020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	2020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	2019年1月10日現在	2020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	15,276,869	43,867,826
投資証券	2,120,342	57,430
合計	13,156,527	43,925,256

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年10月16日から2019年1月10日まで、及び2019年10月16日から2020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

2019年1月10日現在	2020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)

	2019年1月10日現在	2020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)	1.7905円 (17,905円)	2.1063円 (21,063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	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP GROUP LTD	8,600	40.030	344,258.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,300	24.830	181,259.000	
	WESTPAC BANKING CORP	3,800	24.470	92,986.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	16,600	5.460	90,636.000	
	NEWCREST MINING LTD	2,700	31.190	84,213.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,250	81.490	183,352.500	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	4,800	37.220	178,656.000	
	TELSTRA CORP LTD	28,900	3.800	109,820.000	
	SUPER RETAIL GROUP LTD	9,900	10.190	100,881.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,500	139.130	208,695.000	
	CSL LTD	1,900	291.100	553,090.000	
	WESFARMERS LTD	4,000	43.290	173,160.000	
COCHLEAR LTD	600	229.610	137,766.000		
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,438,772.500 (183,322,528)	
オフショア・人民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	1,102.700	220,540.000	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	8,299	31.450	261,003.550	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	85,600	5.990	512,744.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 994,287.550 (15,729,629)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,500	26.790	174,135.000	

	CAPITALAND LTD	23,700	3.840	91,008.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	49,400	3.360	165,984.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 431,127.000 (34,964,400)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	300	230,500.000	69,150,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	600	111,500.000	66,900,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	761	166,500.000	126,706,500.000	
	KT CORP	2,900	26,050.000	75,545,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	60	1,324,000.000	79,440,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,900	46,500.000	88,350,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	13,350	58,600.000	782,310,000.000	
	LG ELECTRONICS INC	1,100	66,600.000	73,260,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	5,600	35,050.000	196,280,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	400	137,500.000	55,000,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,612,941,500.000 (152,584,266)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION- H	57,500	8.900	511,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	10,000	60.200	602,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,500	118.200	531,900.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	92,000	10.740	988,080.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	16,000	30.200	483,200.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	66,000	7.320	483,120.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	29,000	18.460	535,340.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	66,000	7.110	469,260.000	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	20,500	30.850	632,425.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	60,000	10.600	636,000.000	
	CNOOC LTD	41,000	13.680	560,880.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	11,000	57.150	628,650.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	85,000	6.670	566,950.000	
	CHINA MOBILE LTD	16,000	64.850	1,037,600.000	
	AIA GROUP LTD	6,800	85.600	582,080.000	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	16.040	481,200.000	

	SANDS CHINA LTD	14,000	43.000	602,000.000	
	LI NING CO LTD	21,500	26.500	569,750.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	3,500	141.000	493,500.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	29,000	22.500	652,500.000	
	LENOVO GROUP LTD	42,000	5.430	228,060.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	62,000	7.910	490,420.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	18,500	37.850	700,225.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 13,466,890.000 (190,017,818)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	WIWYNN CORP	3,000	688.000	2,064,000.000	
	MEDIATEK INC	13,000	437.000	5,681,000.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	131,000	30.900	4,047,900.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	181,000	22.300	4,036,300.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	31,000	137.000	4,247,000.000	
	CTCI CORP	47,000	37.250	1,750,750.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	56,000	337.500	18,900,000.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	306.500	3,984,500.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 44,711,450.000 (163,196,792)	
合計				739,815,433 [739,815,433]	

## (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	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	38,200	103,904.000	
		オーストラリア・ドル 小計		103,904.000 (7,810,464)	
投資証券 合計				7,810,464 [7,810,464]	
合計				7,810,464 [7,810,464]	

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
オーストラリア・ドル	株式 13銘柄 投資証券 1銘柄	95.9%	4.1%	25.6%
オフショア・人民元	株式 3銘柄	100%	-%	2.1%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	4.7%
韓国・ウォン	株式 10銘柄	100%	-%	20.4%
香港・ドル	株式 23銘柄	100%	-%	25.4%
台湾・ドル	株式 8銘柄	100%	-%	21.8%

## 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

	2019年1月10日現在	2020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	1,421,764,635	421,027,153
株式	16,512,574,500	17,061,261,230
未収入金	17,911,974	67,790,026
未収配当金	40,665,000	33,336,850
流動資産合計	17,992,916,109	17,583,415,259
資産合計	17,992,916,109	17,583,415,259
負債の部		
流動負債		

未払金		388,484,061	1,663,613
未払解約金		6,000,000	9,300,000
その他未払費用		28,792	-
流動負債合計		394,512,853	10,963,613
負債合計		394,512,853	10,963,613
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,925,910,602	6,085,455,292
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		10,672,492,654	11,486,996,354
元本等合計		17,598,403,256	17,572,451,646
純資産合計		17,598,403,256	17,572,451,646
負債純資産合計		17,992,916,109	17,583,415,259

## 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 2020年1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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  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。
3. 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1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首	2018年1月11日	2019年1月11日
期首元本額	6,857,276,545円	6,925,910,602円
期中追加設定元本額	1,066,341,766円	434,496,244円
期中一部解約元本額	997,707,709円	1,274,951,554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)	5,308,438,930円	4,371,717,264円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	29,355,376円	26,532,128円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	31,060,367円	27,851,210円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	28,563,870円	24,665,342円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	510,956,622円	444,487,092円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	90,789,419円	75,782,733円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	86,323,444円	75,973,500円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	139,429,198円	168,401,560円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	277,930,622円	329,593,808円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	423,062,754円	540,450,655円
計	6,925,910,602円	6,085,455,292円
2. 期末日における受益権の総数	6,925,910,602口	6,085,455,292口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年1月11日 至 2020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せん。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020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	2019年1月10日現在	2020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	1,893,018,091	1,442,011,179
合計	1,893,018,091	1,442,011,179

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年10月16日から2019年1月10日まで、及び2019年10月16日から2020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

2019年1月10日現在	2020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)

	2019年1月10日現在	2020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)	2.5410円 (25,410円)	2.8876円 (28,876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	
ミライト・ホールディングス	15,000	1,718.00	25,770,000	
国際石油開発帝石	75,000	1,170.00	87,750,000	
大成建設	12,500	4,500.00	56,250,000	
熊谷組	30,000	3,285.00	98,550,000	
五洋建設	135,000	677.00	91,395,000	
住友林業	50,500	1,596.00	80,598,000	
大和ハウス	21,300	3,400.00	72,420,000	
積水ハウス	55,000	2,374.00	130,570,000	
日本工営	7,900	3,535.00	27,926,500	
九電工	31,000	3,255.00	100,905,000	
ブルボン	23,200	1,798.00	41,713,600	
エレマテック	22,800	1,150.00	26,220,000	
パルグループHLDGS	34,300	3,695.00	126,738,500	
JALUX	4,900	2,523.00	12,362,700	
太陽化学	23,000	2,169.00	49,887,000	
日本たばこ産業	66,800	2,415.50	161,355,400	
アルコニックス	66,300	1,429.00	94,742,700	
J. フロント リテイリング	45,000	1,551.00	69,795,000	

東洋紡	53,900	1,595.00	85,970,500
ダイワボウHD	16,100	6,560.00	105,616,000
レスターホールディングス	32,000	2,027.00	64,864,000
TOKAIホールディングス	211,700	1,084.00	229,482,800
三洋貿易	74,600	2,512.00	187,395,200
旭化成	105,000	1,194.50	125,422,500
SUMCO	70,000	1,881.00	131,670,000
川田テクノロジーズ	13,400	6,570.00	88,038,000
信和	55,800	1,143.00	63,779,400
コメダホールディングス	32,800	2,143.00	70,290,400
共和レザー	67,900	815.00	55,338,500
マツオカコーポレーション	19,800	2,401.00	47,539,800
SRAホールディングス	7,800	2,638.00	20,576,400
クレハ	15,000	6,680.00	100,200,000
大阪ソーダ	22,300	3,045.00	67,903,500
信越化学	9,300	11,960.00	111,228,000
日本化学工業	11,500	3,110.00	35,765,000
四国化成	46,900	1,355.00	63,549,500
日本触媒	9,500	6,550.00	62,225,000
三井化学	27,200	2,581.00	70,203,200
三菱ケミカルHLDGS	141,300	811.20	114,622,560
タキロンシーアイ	146,700	726.00	106,504,200
旭有機材	58,400	1,737.00	101,440,800
リケンテクノス	52,400	522.00	27,352,800
ダイキアクシス	81,100	915.00	74,206,500
電通グループ	37,500	3,785.00	141,937,500
第一工業製薬	56,000	4,255.00	238,280,000
三洋化成	6,200	5,230.00	32,426,000
武田薬品	110,000	4,379.00	481,690,000
アステラス製薬	100,000	1,880.00	188,000,000
沢井製薬	11,600	7,090.00	82,244,000
大塚ホールディングス	50,000	4,994.00	249,700,000
日本特殊塗料	18,000	1,458.00	26,244,000
太陽ホールディングス	10,000	4,580.00	45,800,000
DIC	15,000	2,975.00	44,625,000
日本空調サービス	29,200	836.00	24,411,200
パーク24	35,300	2,602.00	91,850,600
Zホールディングス	786,400	481.00	378,258,400
伊藤忠テクノソリューションズ	12,300	3,270.00	40,221,000
デクセリアルズ	145,000	1,085.00	157,325,000

出光興産	28,100	3,015.00	84,721,500	
J X T Gホールディングス	138,600	502.80	69,688,080	
ブリヂストン	30,000	4,007.00	120,210,000	
東海カーボン	51,300	1,039.00	53,300,700	
黒崎播磨	17,500	6,400.00	112,000,000	
ニチアス	59,500	2,771.00	164,874,500	
日本冶金工	25,100	2,268.00	56,926,800	
栗本鉄工所	32,200	2,138.00	68,843,600	
大紀アルミニウム	99,700	767.00	76,469,900	
三井金属	39,300	2,840.00	111,612,000	
住友鉱山	27,500	3,502.00	96,305,000	
アサヒHD	34,800	2,744.00	95,491,200	
O S J B HD	236,800	268.00	63,462,400	
日東精工	121,700	640.00	77,888,000	
東京製綱	71,300	1,256.00	89,552,800	
マルゼン	32,600	2,270.00	74,002,000	
ファインシンター	19,500	2,059.00	40,150,500	
タクマ	55,800	1,272.00	70,977,600	
牧野フライス	4,000	4,875.00	19,500,000	
DMG森精機	30,000	1,682.00	50,460,000	
ソディック	68,700	974.00	66,913,800	
ベルシステム24HDGS	65,700	1,635.00	107,419,500	
豊田自動織機	26,700	6,330.00	169,011,000	
技研製作所	21,200	4,900.00	103,880,000	
荏原実業	42,900	2,295.00	98,455,500	
三精テクノロジーズ	30,000	883.00	26,490,000	
北越工業	64,800	1,324.00	85,795,200	
ダイフク	11,000	7,210.00	79,310,000	
キトー	59,700	1,667.00	99,519,900	
JUKI	61,800	856.00	52,900,800	
ブラザー工業	23,800	2,313.00	55,049,400	
三菱電機	75,000	1,519.00	113,925,000	
明電舎	21,900	2,374.00	51,990,600	
愛知電機	20,000	2,805.00	56,100,000	
MCJ	161,700	859.00	138,900,300	
テクノメディカ	1,700	2,072.00	3,522,400	
EIZO	19,600	3,900.00	76,440,000	
TDK	11,500	12,550.00	144,325,000	
アドバンテスト	33,900	6,350.00	215,265,000	
エスベック	35,400	2,279.00	80,676,600	

デンソー	39,400	4,850.00	191,090,000
ウシオ電機	43,800	1,776.00	77,788,800
ファナック	4,500	20,670.00	93,015,000
村田製作所	24,000	6,884.00	165,216,000
I H I	70,000	2,782.00	194,740,000
プレミアグループ	71,400	2,288.00	163,363,200
日産自動車	50,000	636.90	31,845,000
トヨタ自動車	52,200	7,661.00	399,904,200
三菱自動車工業	160,000	451.00	72,160,000
ミクニ	69,700	348.00	24,255,600
アイシン精機	25,700	3,900.00	100,230,000
本田技研	77,600	3,060.00	237,456,000
萩原電気H L D G S	18,200	2,768.00	50,377,600
アルゴグラフィックス	14,900	3,515.00	52,373,500
ダイトロン	57,100	1,972.00	112,601,200
キヤノン	28,500	3,060.00	87,210,000
トランザクション	85,000	971.00	82,535,000
藤森工業	10,600	3,515.00	37,259,000
天馬	9,200	2,008.00	18,473,600
信越ポリマー	130,400	1,063.00	138,615,200
任 天 堂	3,000	43,440.00	130,320,000
バルカー	6,700	2,548.00	17,071,600
伊 藤 忠	41,900	2,574.50	107,871,550
三井物産	119,000	1,971.50	234,608,500
東京エレクトロン	7,800	24,840.00	193,752,000
スターゼン	14,900	4,350.00	64,815,000
セイコーHD	55,900	2,954.00	165,128,600
日本ユニシス	12,000	3,545.00	42,540,000
三菱商事	88,300	2,897.00	255,805,100
阪和興業	8,600	2,829.00	24,329,400
ニプロ	42,900	1,296.00	55,598,400
三菱UFJフィナンシャルG	664,700	578.20	384,329,540
りそなホールディングス	150,000	472.10	70,815,000
三井住友トラストHD	45,100	4,277.00	192,892,700
三井住友フィナンシャルG	89,300	4,024.00	359,343,200
セブン銀行	275,000	344.00	94,600,000
S B Iホールディングス	65,000	2,439.00	158,535,000
オリックス	135,000	1,858.50	250,897,500
S O M P Oホールディングス	20,000	4,239.00	84,780,000
M S & A D	55,000	3,670.00	201,850,000

第一生命HLDGS	40,000	1,761.50	70,460,000	
東京海上HD	69,600	6,042.00	420,523,200	
三井不動産	17,500	2,742.00	47,985,000	
東京建物	85,000	1,726.00	146,710,000	
西日本旅客鉄道	11,200	9,451.00	105,851,200	
丸全昭和運輸	36,500	3,160.00	115,340,000	
九州旅客鉄道	17,300	3,645.00	63,058,500	
SGホールディングス	19,200	2,478.00	47,577,600	
西本WISMETTAC HD	18,000	3,515.00	63,270,000	
日本電信電話	170,000	2,788.50	474,045,000	
KDDI	95,000	3,288.00	312,360,000	
ソフトバンク	119,900	1,477.00	177,092,300	
NTTドコモ	30,800	3,074.00	94,679,200	
日本管財	10,400	1,970.00	20,488,000	
丹青社	50,900	1,340.00	68,206,000	
コナミホールディングス	11,200	4,475.00	50,120,000	
日鉄物産	29,500	5,140.00	151,630,000	
合計			17,061,261,230	

## (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14期計算期間（2019年1月11日から2020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】

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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	64,320,910	85,872,196
親投資信託受益証券	4,252,751,973	5,731,930,567
未収入金	5,162,000	9,212,000
流動資産合計	4,322,234,883	5,827,014,763
資産合計	4,322,234,883	5,827,014,763
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,073,910	12,577,399
未払受託者報酬	1,161,537	1,465,395
未払委託者報酬	23,231,565	29,308,638
その他未払費用	175,657	221,428
流動負債合計	31,642,669	43,572,860
負債合計	31,642,669	43,572,860
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,605,579,705	1 3,061,995,528
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,685,012,509	2,721,446,375
（分配準備積立金）	718,125,584	1,028,078,333
元本等合計	4,290,592,214	5,783,441,903
純資産合計	4,290,592,214	5,783,441,903
負債純資産合計	4,322,234,883	5,827,014,763

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 自 2018年1月11日 至 2019年1月10日	第14期 自 2019年1月11日 至 2020年1月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	8	129
有価証券売買等損益	217,325,606	730,980,594
その他収益	-	5,361
<b>営業収益合計</b>	<b>217,325,598</b>	<b>730,986,084</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	33,464	35,267
受託者報酬	2,210,043	2,716,605
委託者報酬	1 44,202,486	1 54,333,478
その他費用	337,635	409,776
<b>営業費用合計</b>	<b>46,783,628</b>	<b>57,495,126</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>264,109,226</b>	<b>673,490,958</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>264,109,226</b>	<b>673,490,958</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>264,109,226</b>	<b>673,490,958</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（ ）	12,812,985	50,746,440
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>1,676,004,193</b>	<b>1,685,012,509</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>481,759,810</b>	<b>676,574,204</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	481,759,810	676,574,204
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>221,455,253</b>	<b>262,884,856</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	221,455,253	262,884,856
<b>分配金</b>	<b>2 -</b>	<b>2 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>1,685,012,509</b>	<b>2,721,446,375</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14期	
	自 2019年1月11日	至 2020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13期	第14期
	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首元本額	2,218,600,901円	2,605,579,705円
期中追加設定元本額	682,462,389円	853,612,726円
期中一部解約元本額	295,483,585円	397,196,903円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,605,579,705口	3,061,995,528口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 2018年1月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2020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	6,560,072円	8,082,436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(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>	<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(404,567,791円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,948,433,334円)及び分配準備積立金(623,510,542円)より分配可能額は2,976,511,667円(1万口当たり9,720.82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14期 自 2019年1月11日 至 2020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14期 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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	215,887,887	704,590,562
合計	215,887,887	704,590,562

## (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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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14期 自 2019年1月11日 至 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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)	1.6467円 (16,467円)	1.8888円 (18,888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	331,858,792	955,089,603	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	732,725,273	951,883,402	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	345,957,189	956,606,223	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	329,593,808	951,735,079	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	227,747,249	706,426,416	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	125,547,416	219,984,182	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	20,069,686	42,272,779	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	291,080,539	947,932,883	
親投資信託受益証券 合計			5,731,930,567	
合計			5,731,930,567	

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14期計算期間（2019年1月11日から2020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】

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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	68,698,555	100,922,205
親投資信託受益証券	4,385,690,128	6,271,243,299
未収入金	1,371,000	6,870,000
流動資産合計	4,455,759,683	6,379,035,504
資産合計	4,455,759,683	6,379,035,504
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,746,683	12,914,310
未払受託者報酬	1,218,300	1,603,359
未払委託者報酬	28,021,717	36,878,037
その他未払費用	184,243	242,271
流動負債合計	31,170,943	51,637,977
負債合計	31,170,943	51,637,977
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,571,575,161	1 3,104,040,281
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,853,013,579	3,223,357,246
（分配準備積立金）	845,241,642	1,268,061,314
元本等合計	4,424,588,740	6,327,397,527
純資産合計	4,424,588,740	6,327,397,527
負債純資産合計	4,455,759,683	6,379,035,504

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期		第14期	
	自	2018年1月11日 至 2019年1月10日	自	2019年1月11日 至 2020年1月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		9		112
有価証券売買等損益		329,013,471		974,384,171
その他収益		-		11,239
<b>営業収益合計</b>		<b>329,013,462</b>		<b>974,395,522</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		35,953		39,244
受託者報酬		2,305,156		2,931,282
委託者報酬	1	53,020,474	1	67,421,319
その他費用		352,352		442,202
<b>営業費用合計</b>		<b>55,713,935</b>		<b>70,834,047</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>384,727,397</b>		<b>903,561,475</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>		<b>384,727,397</b>		<b>903,561,475</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>384,727,397</b>		<b>903,561,475</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（ ）		17,954,030		56,495,608
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>1,911,665,087</b>		<b>1,853,013,579</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>547,753,097</b>		<b>794,005,194</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		547,753,097		794,005,194
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>239,631,238</b>		<b>270,727,394</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		239,631,238		270,727,394
<b>分配金</b>		<b>2 -</b>		<b>2 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,853,013,579</b>		<b>3,223,357,246</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14期	
	自 2019年1月11日	至 2020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13期	第14期
	2019年1月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首元本額	2,170,099,737円	2,571,575,161円
期中追加設定元本額	676,061,653円	898,116,398円
期中一部解約元本額	274,586,229円	365,651,278円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,571,575,161口	3,104,040,281口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 2018年1月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2020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	9,229,243円	11,738,990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(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>	<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(524,362,000円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,383,882,207円)及び分配準備積立金(743,699,314円)より分配可能額は3,651,943,521円(1万口当たり11,765.13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14期 自 2019年1月11日 至 2020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14期 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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	326,071,640	948,130,460
合計	326,071,640	948,130,460

## (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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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14期 自 2019年1月11日 至 2020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13期 2019年1月10日現在	第14期 2020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)	1.7206円 (17,206円)	2.0384円 (20,384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	108,639,633	312,664,863	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	240,167,951	312,002,185	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	454,017,584	1,255,404,021	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	540,450,655	1,560,605,311	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	373,896,123	1,159,750,994	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	206,228,414	361,353,427	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	33,139,216	69,801,130	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	380,661,232	1,239,661,368	
親投資信託受益証券 合計			6,271,243,299	
合計			6,271,243,299	

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。

## 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】

2020年1月31日

資産総額	5,044,419,171円
負債総額	4,550,998円
純資産総額（ - ）	5,039,868,173円
発行済数量	2,831,395,426口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7800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

2020年1月31日

資産総額	196,626,337,860円
負債総額	453,608,993円
純資産総額（ - ）	196,172,728,867円
発行済数量	67,339,087,832口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.9132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

2020年1月31日

資産総額	21,370,434,442円
負債総額	2,878,564円
純資産総額（ - ）	21,367,555,878円
発行済数量	16,347,824,854口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3071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

2020年1月31日

資産総額	92,651,850,095円
負債総額	376,796,854円
純資産総額( - )	92,275,053,241円
発行済数量	32,514,560,118口
1単位当たり純資産額( / )	2.8380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

2020年1月31日

資産総額	120,640,034,969円
負債総額	618,630,365円
純資産総額( - )	120,021,404,604円
発行済数量	35,502,366,988口
1単位当たり純資産額( / )	3.3807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

2020年1月31日

資産総額	2,845,718,104円
負債総額	2,000,000円
純資産総額( - )	2,843,718,104円
発行済数量	915,778,515口
1単位当たり純資産額( / )	3.1052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

2020年1月31日

資産総額	1,294,584,491円
負債総額	1,000,000円
純資産総額( - )	1,293,584,491円

発行済数量	754,808,339口
1単位当たり純資産額( / )	1.7138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

2020年1月31日

資産総額	716,837,104円
負債総額	3,003,889円
純資産総額( - )	713,833,215円
発行済数量	357,683,828口
1単位当たり純資産額( / )	1.9957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

2020年1月31日

資産総額	16,858,536,986円
負債総額	14,026,040円
純資産総額( - )	16,844,510,946円
発行済数量	6,027,926,694口
1単位当たり純資産額( / )	2.7944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

2020年1月31日

資産総額	5,909,090,454円
負債総額	8,078,261円
純資産総額( - )	5,901,012,193円
発行済数量	3,103,709,322口
1単位当たり純資産額( / )	1.9013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

2020年1月31日

資産総額	6,414,038,078円
負債総額	10,126,377円
純資産総額( - )	6,403,911,701円
発行済数量	3,131,324,179口
1単位当たり純資産額( / )	2.0451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

2020年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 運用会議

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

##### ハ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ニ. 運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

###### ・運用審査会議

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

###### ・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	63	117,577
追加型株式投資信託	696	16,519,998
株式投資信託 合計	759	16,637,574
単位型公社債投資信託	30	101,950
追加型公社債投資信託	14	1,486,108
公社債投資信託 合計	44	1,588,057
総合計	803	18,225,632

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836

出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725

福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項  
（重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

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

## 3．引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

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

(未適用の会計基準等)

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

## (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

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

(損益計算書)

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

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

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

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

## （貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(注1)金融商品の時価の算定方法

資 産

(1)現金・預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1)未払手数料、(2)その他未払金、並びに(3)未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

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

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

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (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)
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。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2019年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	211
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（2019年9月30日）

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

（2）中間損益計算書

（単位：百万円）

## 当中間会計期間

(自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

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

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

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

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2)無形固定資産

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

## 3．引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)退職給付引当金

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

## (3)役員退職慰労引当金

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

## 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1)消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## (2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

## 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

## 2 消費税等の取扱い

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

## 3 保証債務

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

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

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(注1)金融商品の時価の算定方法

資 産

(1)現金・預金及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1)未払金及び(2)未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

( 1 株当たり情報 )

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 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 518千米ドル（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。

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

### 第3 【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。

(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

2020年2月14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2020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2020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

2020年2月14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2020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2020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

2020年2月14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（六つの羽ノ成長コース）の2019年1月11日から2020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（六つの羽ノ成長コース）の2020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11月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。