

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2022年4月4日提出
【計算期間】	第16計算期間 (自 2021年1月13日 至 2022年1月11日)
【ファンド名】	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)
【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 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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）

## 商品分類表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表〈各ファンド共通〉

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

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

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	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
投資対象地域	国内	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、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、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

投資対象 資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に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を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を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
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	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	
	資産複合 資産配 分変更型	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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
決算頻度	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	
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
	年6回(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
	年12回(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの	

投資対象地域	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
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	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
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	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
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

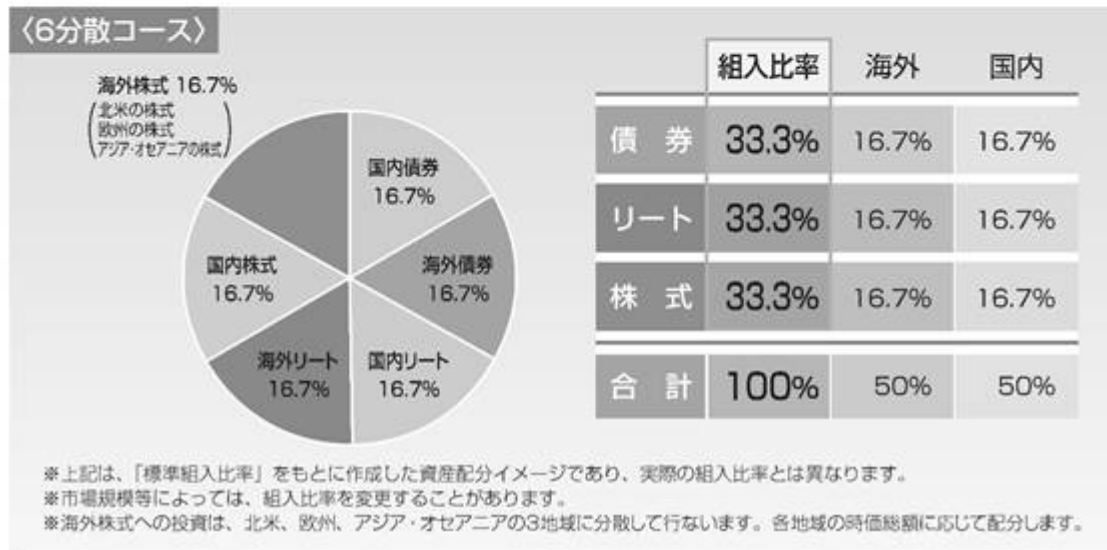
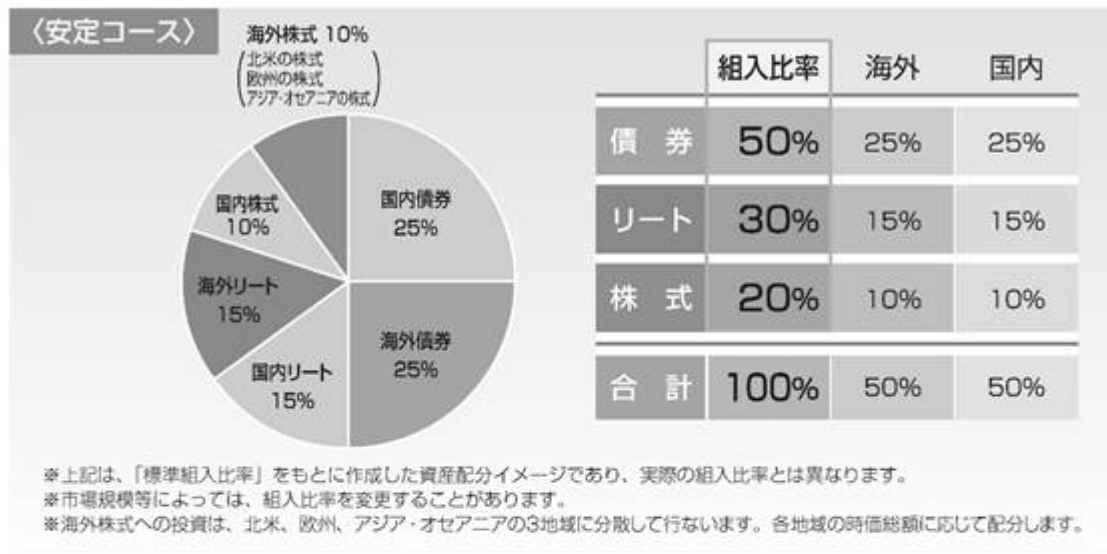
#### < 信託金の限度額 >

- ・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〉



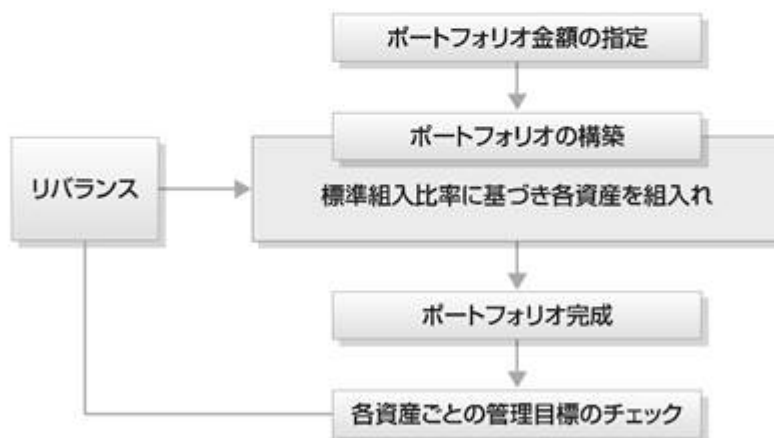
	組入比率	海外	国内
債券	10%	5%	5%
リート	40%	20%	20%
株式	50%	25%	25%
合計	100%	50%	50%

※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。

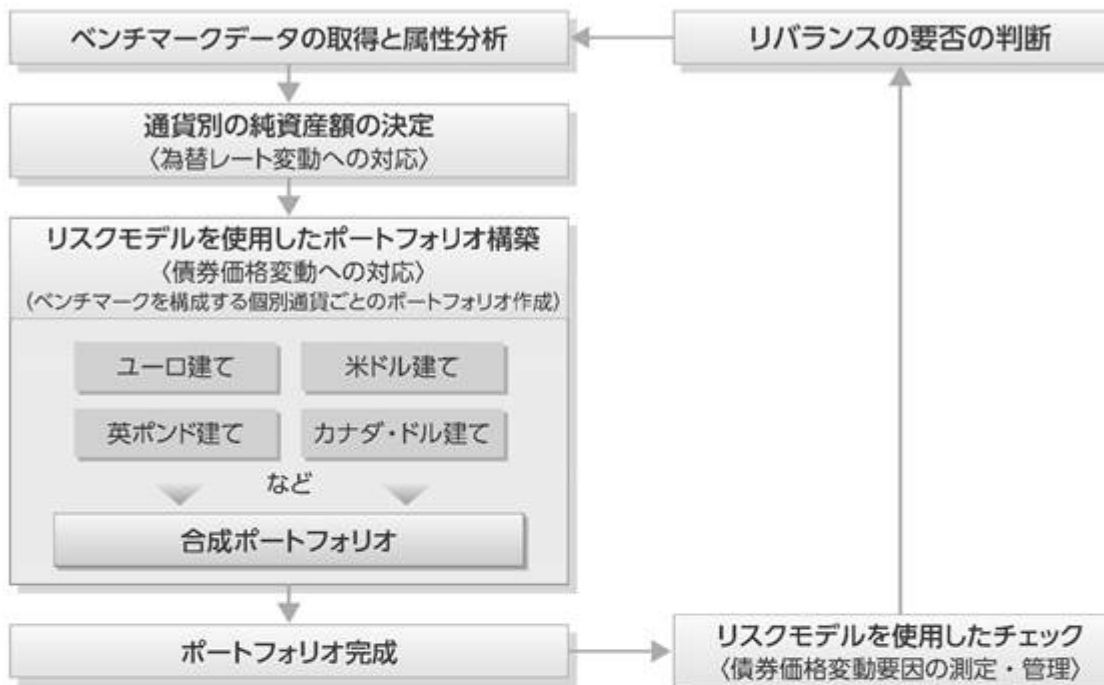
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



## 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。

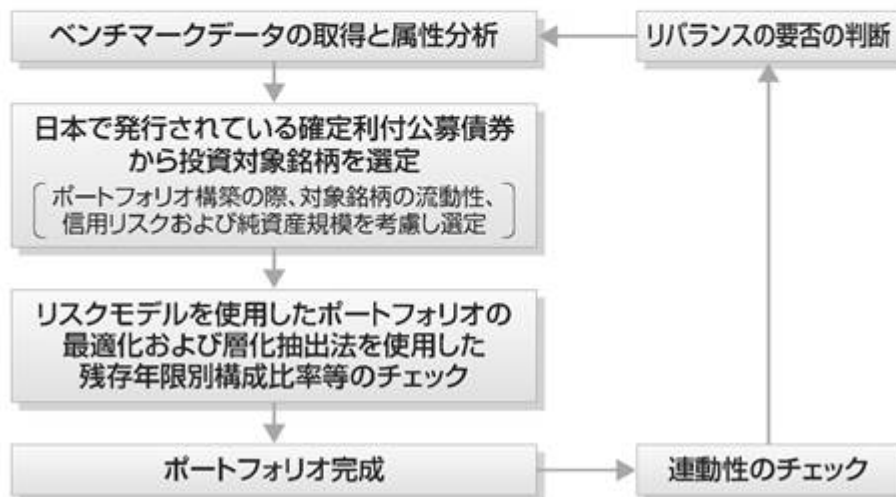
## FTSE世界国債インデックスとは

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。

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

### 銘柄選定プロセス



定量・定性分析による銘柄選定

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

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

• 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、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</p> <p style="text-align: right;">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</p> <p style="text-align: right;">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： 株式会社日本カストディ銀行</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株式会社日本カストディ銀行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</p> <p style="text-align: right;">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;ステイアーズ・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;ステイアーズ・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。

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

#### < 委託会社の概況（2022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 大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 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)
- 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

#### ・ 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。）

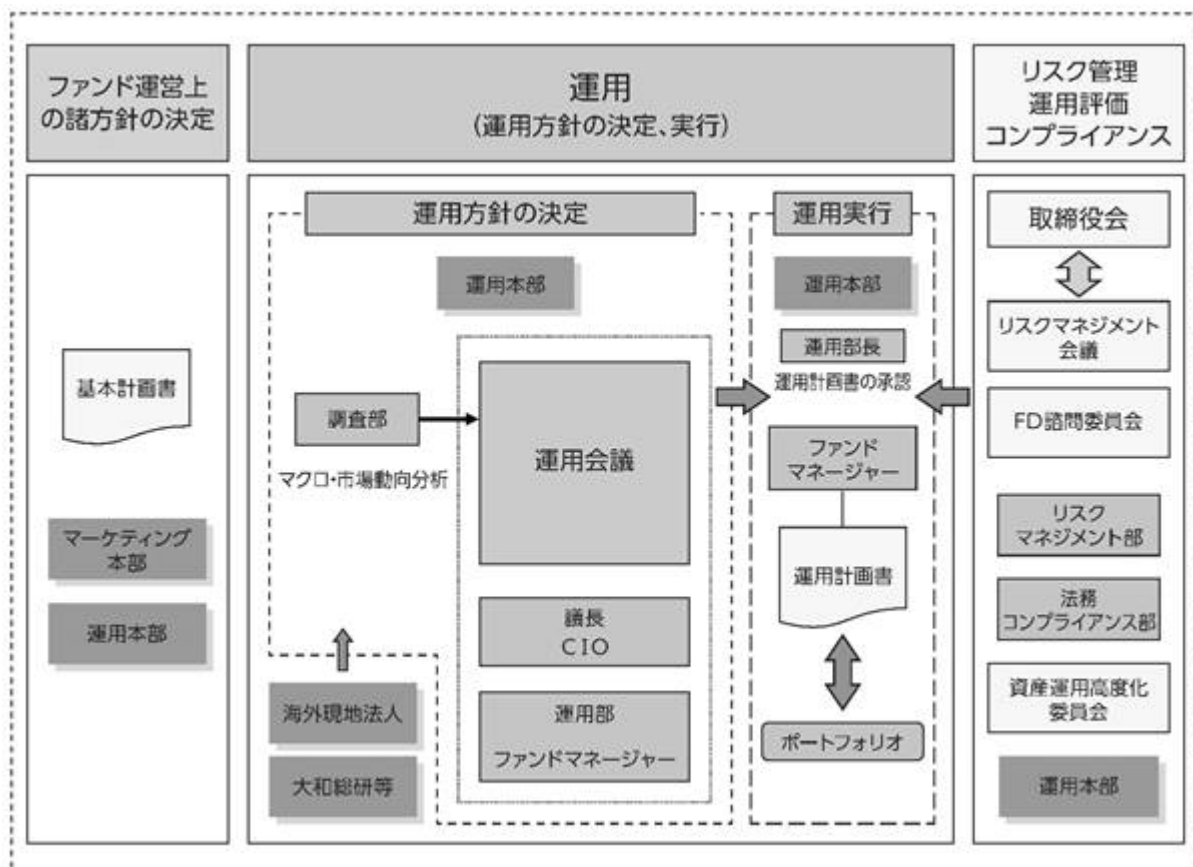
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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商品担当役員の決裁により決定します。

#### 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。

#### 八．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) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・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決定します。

##### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

##### ヘ．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。

#### リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は45～55名程度です。

##### イ．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。

##### ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

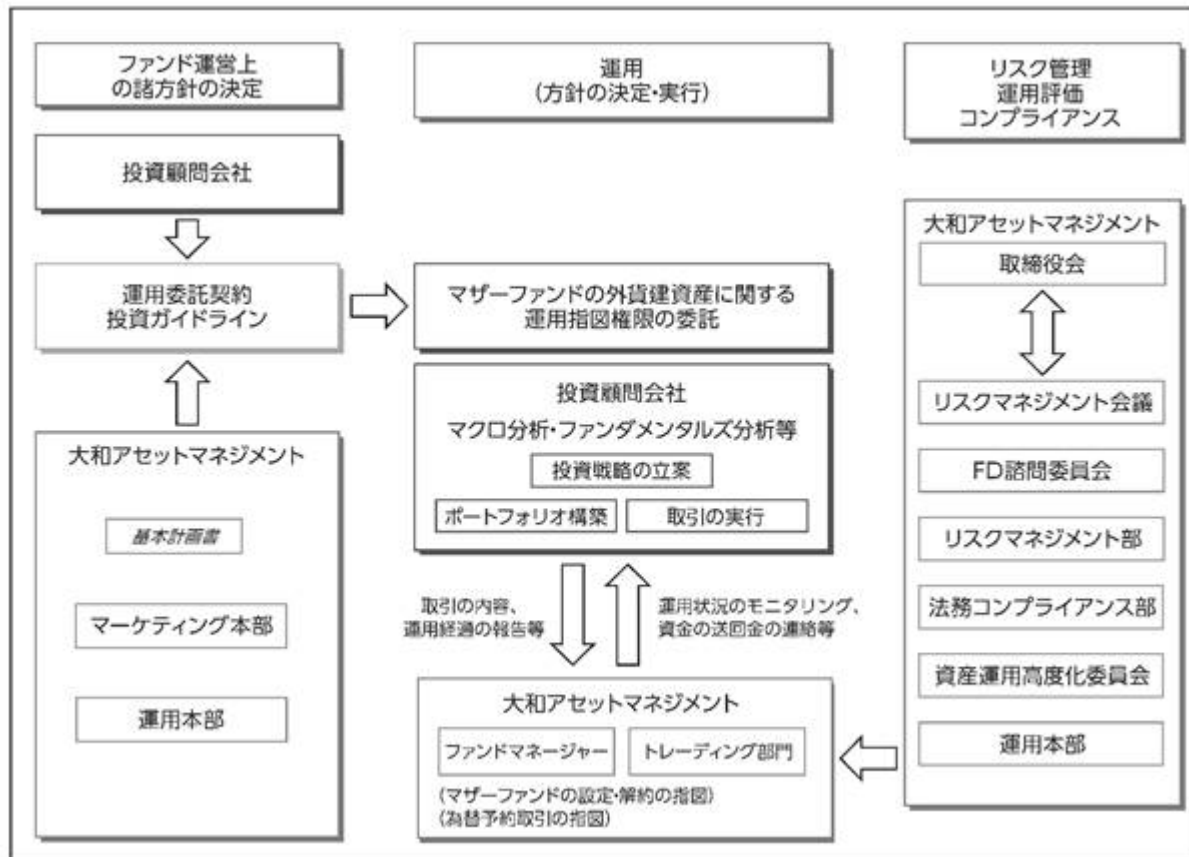
##### ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、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商品担当役員の決裁により決定します。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。

#### ニ．リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会 (前 に同じ。)

上記の運用体制は2022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)【配分方針】

## &lt;各ファンド共通&gt;

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】

## &lt;各ファンド共通&gt;

## 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。

二．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、
- ロ. 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

#### 同一銘柄の株式

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第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号口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号八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。

へ。委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し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。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

#### 株式

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

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

#### スワップ取引

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

#### 金利先渡取引

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

### 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資方針

## 主要投資対象

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

### 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

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

4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

6．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

#### 4. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

#### ハ．約束手形

二．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号口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

## &lt;ダイワ北米好配当株マザーファンド&gt;

## 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。

## &lt;ダイワ欧州好配当株マザーファンド&gt;

## 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）

## &lt;ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド&gt;

## 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. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

##### 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

##### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

##### 先物取引等

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

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

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

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

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

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

#### スワップ取引

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を

超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

## 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

ニ．J-REIT（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証券

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（組入有価証券を差し引いた額）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。



- 二．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。

ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、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)換金性等が制限される場合

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付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受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。

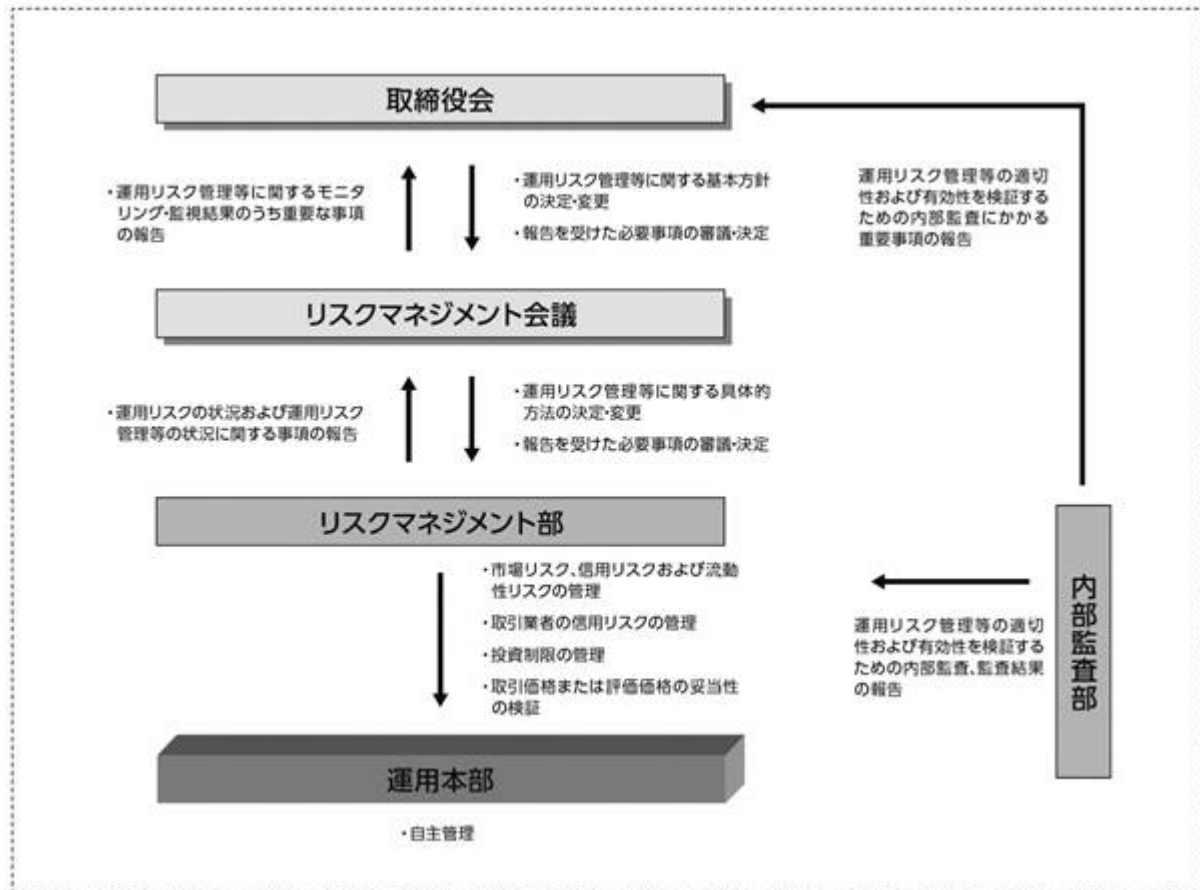
##### 流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

#### (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

- ・ 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行いません。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

## 参考情報

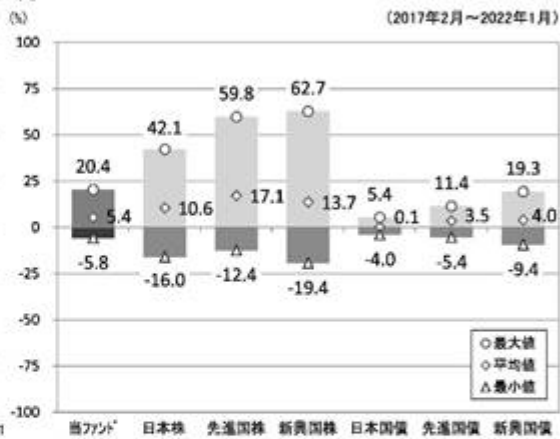
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

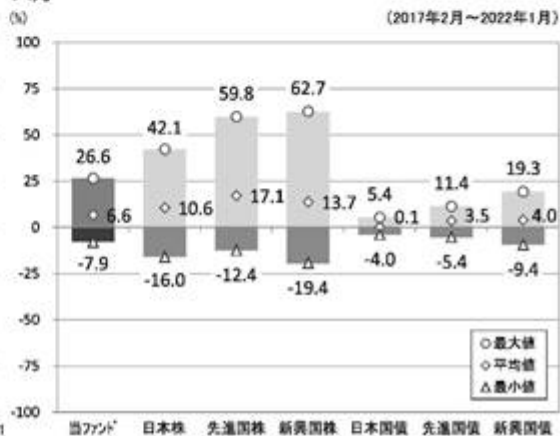
#### [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）]



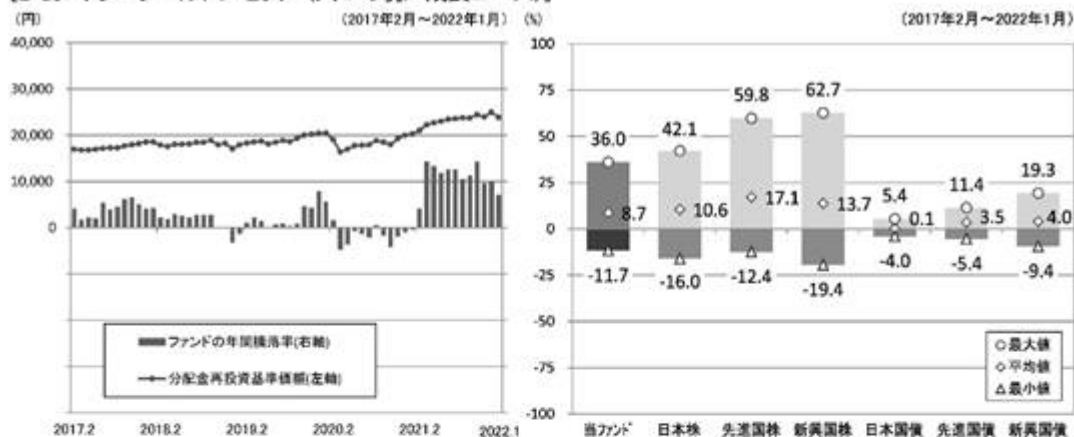
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

## (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ます。

#### 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年率0.57%以内の率を乗じて得た額とします。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ます。

#### 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。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。



## 八．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。

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。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

### <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、2022年1月末日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）】

## (1)【投資状況】（2022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	7,275,587,319	99.12
内 日本	7,275,587,319	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	64,556,762	0.88
純資産総額	7,340,144,081	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】（2022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	1,433,311,379	1.2840 1,840,380,788	1.2803 1,835,068,558	25.00
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	590,333,780	3.1298 1,847,681,445	3.1023 1,831,392,485	24.95
3	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	323,451,227	3.4715 1,122,878,422	3.3741 1,091,356,785	14.87
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	300,467,977	3.7521 1,127,401,234	3.5829 1,076,546,714	14.67
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	213,283,398	3.5195 750,668,190	3.3804 720,983,198	9.82
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	128,802,192	4.5070 580,516,565	4.2981 553,604,701	7.54

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	66,394,124	2.1900 145,403,133	2.1508 142,800,481	1.95
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	8,372,053	2.9640 24,814,769	2.8469 23,834,397	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
親投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

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

#### 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
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
第15計算期間末 (2021年1月12日)	5,838,750,574	5,838,750,574	1.7702	1.7702
2021年1月末日	5,899,343,635	-	1.7794	-
2月末日	6,052,978,221	-	1.8097	-
3月末日	6,378,204,255	-	1.8784	-
4月末日	6,537,899,067	-	1.9024	-
5月末日	6,677,948,829	-	1.9247	-
6月末日	6,842,283,440	-	1.9468	-
7月末日	6,949,845,663	-	1.9591	-
8月末日	7,047,031,164	-	1.9679	-
9月末日	7,073,003,914	-	1.9510	-
10月末日	7,277,779,703	-	1.9957	-
11月末日	7,306,117,054	-	1.9706	-
12月末日	7,554,130,266	-	2.0171	-
第16計算期間末 (2022年1月11日)	7,477,305,392	7,477,305,392	1.9976	1.9976
2022年1月末日	7,340,144,081	-	1.9526	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

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
第15計算期間	0.4
第16計算期間	12.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第15計算期間	963,521,848	459,114,213
第16計算期間	842,864,166	398,104,027

## (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 (2022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	230,399,327,472	98.64
内 ユーロ	88,699,468,018	37.97
内 中国	1,548,660,871	0.66
内 シンガポール	993,306,888	0.43
内 マレーシア	1,157,736,348	0.50
内 イスラエル	1,008,000,871	0.43
内 ノルウェー	563,067,041	0.24

内 スウェーデン	630,631,256	0.27
内 デンマーク	1,013,826,231	0.43
内 イギリス	13,492,651,494	5.78
内 ポーランド	1,123,623,706	0.48
内 カナダ	4,620,748,654	1.98
内 アメリカ	110,292,655,488	47.22
内 メキシコ	1,645,652,145	0.70
内 オーストラリア	3,609,298,461	1.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,185,473,808	1.36
純資産総額	233,584,801,280	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)	1,553,431,633	0.67
内 日本	1,553,431,633	0.67

(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 (2022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	10,700,000	96.91 1,197,040,072	94.69 1,169,630,807	1.125000 2031/02/15	0.50
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	10,300,000	97.64 1,161,071,393	95.41 1,134,455,431	1.250000 2031/08/15	0.49
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	93.01 1,073,718,984	91.07 1,051,312,080	0.625000 2030/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	94.91 1,073,807,411	92.83 1,050,253,495	0.875000 2030/11/15	0.45
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,700,000	101.16 1,015,978,204	98.78 992,165,587	1.625000 2031/05/15	0.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,729,000	102.16 911,543,741	100.18 893,904,240	1.625000 2026/05/15	0.38

7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,700,000	99.52 884,683,559	98.49 875,483,568	0.250000 2023/11/15	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,699,000	118.93 872,034,411	116.63 855,214,038	2.750000 2027/10/25	0.37
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,920,000	114.61 872,959,357	111.62 850,180,545	1.500000 2031/05/25	0.36
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,500,000	98.95 856,769,706	97.60 845,029,458	0.375000 2024/09/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,500,000	97.44 843,644,178	95.97 830,960,208	0.250000 2025/06/30	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,700,000	109.49 846,863,684	107.07 828,192,649	2.875000 2028/08/15	0.35
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,800,000	93.24 839,580,805	91.32 822,274,502	0.625000 2030/05/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,600,000	108.20 824,402,985	105.85 806,543,955	2.625000 2029/02/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	109.25 819,768,300	106.90 802,179,861	2.875000 2028/05/15	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,664,000	175.35 826,650,854	168.59 794,778,808	4.500000 2041/04/25	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	111.25 821,978,420	106.50 786,890,757	2.375000 2051/05/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	99.37 803,029,500	97.26 785,979,012	1.250000 2028/03/31	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,087,000	122.73 803,318,678	119.70 783,448,258	2.500000 2030/05/25	0.34
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,000,000	98.95 799,619,402	96.89 782,948,712	1.250000 2028/09/30	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	6,900,000	102.65 817,691,996	98.16 781,911,599	2.000000 2051/08/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,000,000	99.12 801,029,327	96.39 778,908,312	1.375000 2031/11/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,350,000	108.34 794,201,860	106.00 777,026,640	2.750000 2028/02/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	105.91 782,509,578	103.68 766,056,145	2.375000 2027/05/15	0.33

25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	96.50 779,797,200	94.55 764,071,963	0.750000 2028/01/31	0.33
26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,730,000	101.14 745,655,617	100.83 743,362,857	- 2023/04/14	0.32
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,571,000	165.72 761,414,994	160.42 737,041,444	4.000000 2037/01/04	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,162,000	104.36 742,377,100	102.69 730,483,473	2.375000 2024/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	97.10 728,667,092	95.56 717,089,037	0.250000 2025/09/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,800,000	93.96 737,578,483	89.81 705,017,015	1.625000 2050/11/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.64%
合計	98.64%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2022年2月	買建	1,207,000	139,333,183	139,333,545	0.06%
		豪ドル買/円売 2022年2月	買建	140,000	11,529,798	11,308,906	0.00%
		シンガポール・ドル買/円売 2022年2月	買建	378,000	32,163,335	32,184,658	0.01%
		米ドル買/円売 2022年3月	買建	7,151,000	825,500,427	825,274,026	0.35%



英ポンド買/円売 2022年 2月	買建	180,000	28,104,899	27,848,051	0.01%
ユーロ買/円売 2022年2 月	買建	4,022,000	523,560,298	517,482,447	0.22%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

### (1) 投資状況 (2022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	33,523,667,350	89.24
内 日本	33,523,667,350	89.24
地方債証券	1,558,881,900	4.15
内 日本	1,558,881,900	4.15
特殊債券	832,249,100	2.22
内 日本	832,249,100	2.22
社債券	1,321,530,000	3.52
内 日本	1,321,530,000	3.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	329,469,555	0.88
純資産総額	37,565,797,905	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 (2022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 (%)
1 137 5年国債	日本	国債証券	590,000,000	100.42 592,501,600	100.27 591,634,300	0.100000 2023/09/20	1.57
2 139 5年国債	日本	国債証券	580,000,000	100.52 583,073,200	100.34 581,977,800	0.100000 2024/03/20	1.55

3	138 5年国債	日本	国債証券	560,000,000	100.47 562,648,800	100.31 561,736,000	0.100000 2023/12/20	1.50
4	143 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.74 554,097,500	100.48 552,667,500	0.100000 2025/03/20	1.47
5	141 5年国債	日本	国債証券	520,000,000	100.62 523,234,800	100.39 522,054,000	0.100000 2024/09/20	1.39
6	145 5年国債	日本	国債証券	510,000,000	100.81 514,133,400	100.54 512,779,500	0.100000 2025/09/20	1.37
7	144 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.76 453,454,000	100.54 452,439,000	0.100000 2025/06/20	1.20
8	140 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.57 452,587,500	100.36 451,660,500	0.100000 2024/06/20	1.20
9	149 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	100.46 452,104,500	100.13 450,625,500	0.005000 2026/09/20	1.20
10	352 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	101.19 445,250,000	100.56 442,477,200	0.100000 2028/09/20	1.18
11	135 5年国債	日本	国債証券	420,000,000	100.29 421,226,400	100.19 420,827,400	0.100000 2023/03/20	1.12
12	345 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	101.01 414,161,500	100.58 412,402,600	0.100000 2026/12/20	1.10
13	147 5年国債	日本	国債証券	406,000,000	100.47 407,924,440	100.18 406,755,160	0.005000 2026/03/20	1.08
14	347 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.08 404,352,000	100.61 402,476,000	0.100000 2027/06/20	1.07
15	350 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.17 404,692,500	100.61 402,448,000	0.100000 2028/03/20	1.07
16	353 10年国債	日本	国債証券	390,000,000	101.25 394,887,900	100.54 392,141,100	0.100000 2028/12/20	1.04
17	136 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.35 381,356,600	100.23 380,889,200	0.100000 2023/06/20	1.01
18	348 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.13 364,093,200	100.61 362,228,400	0.100000 2027/09/20	0.96
19	358 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.22 364,404,700	100.28 361,018,800	0.100000 2030/03/20	0.96
20	361 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	100.81 362,927,700	99.91 359,683,200	0.100000 2030/12/20	0.96
21	364 10年国債	日本	国債証券	355,000,000	100.43 356,554,900	99.47 353,143,350	0.100000 2031/09/20	0.94
22	351 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	101.21 354,263,000	100.60 352,117,500	0.100000 2028/06/20	0.94

23	360 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	101.01 353,545,500	100.04 350,147,000	0.100000 2030/09/20	0.93
24	148 5年国債	日本	国債証券	340,000,000	100.50 341,706,800	100.17 340,595,000	0.005000 2026/06/20	0.91
25	359 10年国債	日本	国債証券	340,000,000	101.11 343,787,600	100.16 340,564,400	0.100000 2030/06/20	0.91
26	354 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	101.32 334,359,300	100.53 331,758,900	0.100000 2029/03/20	0.88
27	363 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	100.57 331,881,000	99.62 328,775,700	0.100000 2031/06/20	0.88
28	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.85 325,936,000	101.56 324,995,200	0.600000 2024/06/20	0.87
29	355 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.31 324,211,800	100.47 321,529,600	0.100000 2029/06/20	0.86
30	362 10年国債	日本	国債証券	315,000,000	100.74 317,337,300	99.77 314,288,100	0.100000 2031/03/20	0.84

(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	89.24%
地方債証券	4.15%
特殊債券	2.22%
社債券	3.52%
合計	99.12%

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

#### 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（2022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	94,080,228,958	93.58
内 ガーンジー	413,632,814	0.41
内 香港	2,915,969,646	2.90
内 シンガポール	6,825,019,163	6.79
内 イギリス	11,119,109,133	11.06
内 オランダ	1,404,777,249	1.40
内 ベルギー	2,985,266,745	2.97
内 フランス	3,937,382,825	3.92
内 スペイン	1,459,227,769	1.45
内 カナダ	1,688,188,908	1.68
内 アメリカ	47,057,224,717	46.81
内 オーストラリア	13,473,938,580	13.40
内 ニュージーランド	800,491,409	0.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,457,841,228	6.42
純資産総額	100,538,070,186	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）	506,922,886	0.50
内 日本	506,922,886	0.50
為替予約取引（売建）	506,692,037	0.50
内 日本	506,692,037	0.50

(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（2022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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,410,771	1,833.14 4,419,436,148	1,852.28 4,465,435,926	4.44
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	93,505	36,653.12 3,427,254,609	41,624.20 3,892,070,896	3.87
3	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	501,109	5,845.76 2,929,382,951	6,602.01 3,308,328,433	3.29
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	190,762	14,991.96 2,859,917,097	16,900.41 3,223,957,157	3.21
5	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	328,807	10,040.04 3,301,273,743	9,703.88 3,190,705,776	3.17
6	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,285,209	1,421.88 3,249,343,378	1,328.83 3,036,656,561	3.02
7	LINK REIT	香港	投資証券	2,949,692	1,022.24 3,015,318,529	988.56 2,915,969,646	2.90
8	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	162,315	15,771.18 2,559,915,960	17,901.28 2,905,646,393	2.89
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	325,590	7,622.27 2,481,761,105	8,021.92 2,611,858,756	2.60
10	UDR INC	アメリカ	投資証券	382,378	6,175.23 2,361,281,573	6,510.81 2,489,592,800	2.48
11	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,648,485	821.87 2,176,794,505	844.77 2,237,363,852	2.23
12	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,049,217	1,978.09 2,075,480,258	1,977.32 2,074,639,437	2.06
13	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	5,110,977	404.46 2,067,346,055	404.46 2,067,198,535	2.06
14	DEXUS/AU	オーストラリア	投資証券	2,486,895	867.17 2,156,605,446	829.61 2,063,154,453	2.05
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	417,497	4,680.28 1,954,050,594	4,801.14 2,004,465,555	1.99
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	50,517	37,455.66 1,892,147,697	38,342.24 1,936,935,019	1.93
17	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	23,487	96,322.32 2,262,323,200	81,680.72 1,918,435,221	1.91
18	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	474,870	4,080.68 1,937,857,326	4,033.47 1,915,375,608	1.91

19	KLEPIERRE	フランス	投資証券	621,756	2,475.41 1,539,106,243	3,032.51 1,885,485,142	1.88
20	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証券	4,998,912	355.54 1,777,867,484	365.44 1,826,845,591	1.82
21	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	551,241	3,452.81 1,903,331,661	3,258.87 1,796,423,419	1.79
22	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	850,887	2,038.74 1,734,762,880	1,984.03 1,688,188,908	1.68
23	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	76,580	22,705.89 1,738,820,315	21,633.45 1,656,690,060	1.65
24	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガ ポール	投資証券	9,404,432	172.08 1,618,435,604	165.19 1,553,527,527	1.55
25	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	88,132	17,814.00 1,569,990,066	17,186.70 1,514,698,879	1.51
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	771,488	1,914.34 1,476,984,030	1,937.08 1,494,436,444	1.49
27	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	スペイン	投資証券	1,147,949	1,237.58 1,420,781,421	1,271.16 1,459,227,769	1.45
28	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	63,980	21,190.16 1,355,746,846	22,731.29 1,454,347,960	1.45
29	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	490,972	2,516.24 1,235,457,788	2,793.64 1,371,602,946	1.36
30	MIRVAC GROUP	オースト ラリア	投資証券	6,357,442	245.40 1,560,939,428	205.18 1,304,427,578	1.30

(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	93.58%
合計	93.58%

(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	米ドル買/円売 2022年2月	買建	348,942	40,271,698	40,281,491	0.04%
		豪ドル買/円売 2022年2月	買建	4,385,625	354,089,821	354,267,720	0.35%
		英ポンド買/円売 2022年2月	買建	440,363	68,078,927	68,131,706	0.07%
		香港ドル買/円売 2022年2月	買建	2,987,808	44,258,145	44,241,969	0.04%
		米ドル売/円買 2022年2月	売建	4,040,427	466,426,893	466,419,995	0.46%
		ユーロ売/円買 2022年2月	売建	313,009	40,271,698	40,272,042	0.04%

(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 (2022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	120,872,172,200	96.89
内 日本	120,872,172,200	96.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,877,434,543	3.11
純資産総額	124,749,606,743	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)	2,321,400,000	1.86
内 日本	2,321,400,000	1.86

(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 (2022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	日本ビルファンド	日本	投資証券	14,099	709,991.73 10,010,173,488	664,000.00 9,361,736,000	7.50
2	GLP投資法人	日本	投資証券	37,782	184,287.52 6,962,751,251	184,700.00 6,978,335,400	5.59
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	43,676	165,785.51 7,240,848,248	159,300.00 6,957,586,800	5.58
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	65,227	101,154.83 6,598,026,487	96,700.00 6,307,450,900	5.06
5	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	9,949	681,000.00 6,775,269,000	630,000.00 6,267,870,000	5.02
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	17,190	369,416.60 6,350,271,499	358,000.00 6,154,020,000	4.93
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	14,728	324,975.17 4,786,234,338	342,000.00 5,036,976,000	4.04
8	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	29,290	142,073.30 4,161,327,066	135,500.00 3,968,795,000	3.18
9	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	21,010	190,541.17 4,003,270,133	183,600.00 3,857,436,000	3.09
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	22,810	179,472.13 4,093,759,453	164,800.00 3,759,088,000	3.01
11	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	18,478	216,289.13 3,996,590,584	200,200.00 3,699,295,600	2.97
12	API投資法人	日本	投資証券	8,964	438,445.32 3,930,223,929	388,500.00 3,482,514,000	2.79
13	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	4,990	702,845.86 3,507,200,889	696,000.00 3,473,040,000	2.78
14	森ヒルズリート	日本	投資証券	24,535	155,452.37 3,814,024,013	141,000.00 3,459,435,000	2.77



15	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	7,531	479,319.08 3,609,751,994	451,000.00 3,396,481,000	2.72
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	38,288	84,636.16 3,240,549,501	78,200.00 2,994,121,600	2.40
17	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	9,335	323,365.13 3,018,613,511	308,000.00 2,875,180,000	2.30
18	日本アコモデーションファンド 投資法人	日本	投資証券	4,444	633,703.37 2,816,177,807	622,000.00 2,764,168,000	2.22
19	産業ファンド	日本	投資証券	14,233	204,177.44 2,906,057,554	192,500.00 2,739,852,500	2.20
20	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	7,751	358,666.19 2,780,021,663	338,500.00 2,623,713,500	2.10
21	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	6,376	409,636.18 2,611,840,313	375,000.00 2,391,000,000	1.92
22	日本ロジスティクスファンド投資 法人	日本	投資証券	6,394	328,673.14 2,101,536,111	318,000.00 2,033,292,000	1.63
23	ジャパン・ホテル・リート投資法 人	日本	投資証券	36,372	63,575.46 2,312,366,652	55,800.00 2,029,557,600	1.63
24	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	7,351	282,867.25 2,079,357,223	268,800.00 1,975,948,800	1.58
25	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	54,704	42,486.02 2,324,155,452	36,050.00 1,972,079,200	1.58
26	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	11,520	171,053.33 1,970,534,408	165,200.00 1,903,104,000	1.53
27	三井不ロジパーク	日本	投資証券	3,280	588,055.36 1,928,821,627	566,000.00 1,856,480,000	1.49
28	日本リート投資法人	日本	投資証券	4,623	420,817.42 1,945,438,953	387,000.00 1,789,101,000	1.43
29	イオンリート投資	日本	投資証券	12,101	154,226.39 1,866,293,660	145,900.00 1,765,535,900	1.42
30	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	13,384	137,891.61 1,845,541,348	131,900.00 1,765,349,600	1.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.89%
合計	96.89%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 040 3月	買建	1,200	2,401,932,000	2,321,400,000	1.86%

(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（2022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	3,166,729,288	77.78
内 カナダ	93,406,576	2.29
内 アメリカ	3,073,322,712	75.49
ハイブリッド優先証券	706,930,955	17.36
内 アメリカ	706,930,955	17.36
投資証券	21,619,392	0.53
内 アメリカ	21,619,392	0.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	175,943,772	4.32
純資産総額	4,071,223,407	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（2022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	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	6,014	35,629.63 214,276,648	35,585.53 214,011,404	5.26
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	10,718	16,820.53 180,283,106	19,662.89 210,746,911	5.18
3	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	12,133	7,943.88 96,383,710	9,150.92 111,028,219	2.73
4	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	2,902	38,220.56 110,916,168	34,829.40 101,074,926	2.48
5	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,501	58,929.00 88,452,468	64,657.94 97,051,574	2.38
6	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,608	69,489.22 111,738,751	59,816.39 96,184,756	2.36
7	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	16,645	5,175.75 86,150,626	5,295.23 88,139,150	2.16
8	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	259	382,275.51 99,009,386	332,416.40 86,095,849	2.11
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,739	18,870.97 89,429,559	16,924.65 80,205,956	1.97
10	SUNCOR ENERGY INC	カナダ	株式	エネルギー	23,232	2,726.19 63,336,875	3,269.04 75,946,442	1.87
11	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	12,153	5,993.64 72,840,765	6,106.77 74,215,649	1.82
12	DOW INC	アメリカ	株式	素材	9,163	6,780.94 62,133,805	6,931.01 63,508,914	1.56
13	NORFOLK SOUTHERN CORP	アメリカ	株式	資本財・サービス	1,990	31,232.29 62,152,365	31,398.52 62,483,066	1.53
14	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,977	18,483.09 55,024,184	19,831.43 59,038,190	1.45

15	RENEWABLE ENERGY GROUP INC	アメリカ	株式	エネルギー	12,962	6,089.80 78,936,148	4,544.87 58,910,641	1.45
16	MOTOROLA SOLUTIONS INC	アメリカ	株式	情報技術	2,201	28,789.69 63,366,207	26,218.73 57,707,431	1.42
17	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	アメリカ	株式	生活必需品	6,485	7,384.92 47,891,350	8,764.20 56,835,868	1.40
18	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,275	22,097.52 50,271,869	22,885.98 52,065,605	1.28
19	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,434	14,862.90 51,039,199	14,354.96 49,294,946	1.21
20	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	6,570	7,460.31 49,014,882	7,467.81 49,063,535	1.21
21	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,850	26,493.71 49,013,549	26,366.49 48,778,018	1.20
22	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,185	44,116.31 52,277,898	40,058.83 47,469,719	1.17
23	ESSENTIAL UTILITIES INC	アメリカ	株式	公益事業	8,385	5,440.68 45,620,162	5,500.71 46,123,504	1.13
24	DEERE & CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	1,059	38,625.41 40,904,384	43,150.31 45,696,186	1.12
25	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,509	18,420.76 46,217,689	18,088.29 45,383,529	1.11
26	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	アメリカ	株式	素材	1,272	33,243.25 42,285,423	32,049.60 40,767,100	1.00
27	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	3,461	11,660.59 40,357,317	11,751.79 40,672,952	1.00
28	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	131	325,889.42 42,691,515	307,880.78 40,332,383	0.99
29	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,355	28,230.85 38,252,804	29,563.02 40,057,905	0.98
30	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,178	14,406.91 45,785,166	11,905.32 37,835,130	0.93

(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	77.78%
ハイブリッド優先証券	17.36%
投資証券	0.53%
合計	95.68%

(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	3.74%
素材	3.81%
資本財・サービス	8.48%
一般消費財・サービス	6.27%
生活必需品	3.87%
ヘルスケア	7.10%
金融	10.11%
情報技術	24.65%
コミュニケーション・サービス	7.26%
公益事業	2.49%
合計	77.78%

(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（2022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	1,407,446,875	98.27

内 スウェーデン	5,522,798	0.39
内 イギリス	307,110,264	21.44
内 オランダ	122,903,014	8.58
内 フランス	303,647,735	21.20
内 ドイツ	280,107,467	19.56
内 スイス	268,560,248	18.75
内 スペイン	21,575,718	1.51
内 イタリア	98,019,631	6.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,823,144	1.73
純資産総額	1,432,270,019	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（2022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	5,578	14,188.08 79,141,110	14,639.44 81,658,796	5.70
2	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	44,286.60 58,148,306	44,075.80 57,871,525	4.04
3	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,716	18,547.62 50,375,351	18,985.06 51,563,449	3.60
4	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	18,148.77 50,816,583	17,798.82 49,836,708	3.48
5	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	903	48,409.60 43,713,869	54,684.00 49,379,652	3.45
6	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,893	10,824.16 42,138,477	12,127.49 47,212,325	3.30
7	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,883	24,072.28 45,328,115	24,831.38 46,757,489	3.26
8	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,823	6,790.67 46,332,774	6,746.93 46,034,306	3.21

9	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	21,145	2,126.74 44,970,125	2,146.82 45,394,525	3.17
10	AXA SA	フラン ス	株式	金融	12,126	3,049.24 36,975,108	3,593.47 43,574,463	3.04
11	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルス ケア	4,389	9,481.04 41,612,285	9,841.88 43,196,011	3.02
12	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事 業	48,153	892.90 42,995,833	868.71 41,831,104	2.92
13	TOTALENERGIES SE	フラン ス	株式	エネル ギー	6,299	5,635.30 35,496,805	6,592.53 41,526,399	2.90
14	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必 需品	88,445	411.55 36,400,000	469.42 41,517,894	2.90
15	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルス ケア	15,900	2,168.86 34,484,953	2,569.89 40,861,397	2.85
16	MICHELIN (CGDE)	フラン ス	株式	一般消 費財・ サービ ス	2,155	16,970.25 36,570,897	18,925.88 40,785,284	2.85
17	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,037	31,109.98 32,261,058	35,934.73 37,264,323	2.60
18	KONINKLIJKE DSM NV	オラン ダ	株式	素材	1,749	23,319.62 40,786,024	21,151.70 36,994,330	2.58
19	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	77	524,148.00 40,359,396	473,432.00 36,454,264	2.55
20	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消 費財・ サービ ス	2,996	11,111.07 33,288,788	11,888.18 35,616,999	2.49
21	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	659.10 28,607,889	817.38 35,477,811	2.48
22	SHELL PLC	イギリス	株式	エネル ギー	11,761	2,699.55 31,749,460	2,932.25 34,486,232	2.41
23	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	100,555	324.60 32,647,544	334.13 33,598,444	2.35
24	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	25,268.82 28,932,803	29,308.74 33,558,516	2.34

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	351.49 30,906,965	372.98 32,796,228	2.29
26	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	8,374.47 30,784,586	8,814.49 32,402,090	2.26
27	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	7,286.01 29,071,203	8,077.27 32,228,326	2.25
28	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	17,873	1,394.64 24,926,509	1,689.54 30,197,191	2.11
29	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	7,785	4,876.21 37,961,326	3,731.14 29,046,925	2.03
30	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,245.76 33,336,073	1,903.05 28,248,963	1.97

(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	98.27%
合計	98.27%

(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	6.88%
素材	7.39%
資本財・サービス	10.29%
一般消費財・サービス	5.72%
生活必需品	12.12%
ヘルスケア	15.23%
金融	23.97%
情報技術	3.26%
コミュニケーション・サービス	6.86%
公益事業	6.54%
合計	98.27%

(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（2022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	638,528,911	96.41
内 韓国	153,357,795	23.15
内 中国	38,314,433	5.78
内 台湾	188,352,029	28.44
内 香港	63,793,039	9.63
内 シンガポール	30,485,914	4.60
内 オーストラリア	164,225,701	24.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	23,802,443	3.59
純資産総額	662,331,354	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（2022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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	23,000	2,376.05 54,649,359	2,637.30 60,657,928	9.16
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技 術	6,600	6,641.58 43,834,428	7,014.81 46,297,746	6.99
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オースト ラリア	株式	金融	4,150	8,240.85 34,199,746	7,728.22 32,072,124	4.84
4	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オースト ラリア	株式	金融	13,900	2,311.92 32,135,892	2,233.56 31,046,581	4.69

5	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	6,000	3,483.22 20,899,368	4,457.70 26,746,215	4.04
6	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	20,200	1,299.45 26,249,276	1,197.38 24,187,248	3.65
7	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	6,300	3,057.36 19,261,865	3,790.19 23,878,245	3.61
8	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	1,800	8,976.66 16,157,988	11,531.85 20,757,330	3.13
9	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	87,000	235.11 20,455,256	237.60 20,671,714	3.12
10	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	3,200	5,225.22 16,720,704	5,694.15 18,221,280	2.75
11	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,200	4,228.83 17,761,099	4,260.33 17,893,416	2.70
12	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,800	2,590.26 15,023,525	2,964.92 17,196,553	2.60
13	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	9,600	2,041.31 19,596,582	1,666.49 15,998,317	2.42
14	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,000	14,772.23 14,772,239	15,097.78 15,097,782	2.28
15	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	128,000	95.16 12,181,346	114.44 14,649,462	2.21
16	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	3,400	4,201.23 14,284,182	4,306.50 14,642,100	2.21
17	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	2,200	6,870.69 15,115,551	6,463.08 14,218,785	2.15
18	MERIDA INDUSTRY CO LTD	台湾	株式	一般消費財・サービス	11,000	1,119.60 12,315,699	1,202.54 13,227,973	2.00
19	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	85,000	133.93 11,384,765	153.22 13,023,748	1.97
20	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	13,500	935.99 12,635,892	963.39 13,005,772	1.96
21	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	143,000	81.30 11,626,887	88.26 12,622,267	1.91

22	NAVER CORP	韓国	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	390	37,801.50 14,742,585	29,667.00 11,570,130	1.75
23	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	香港	株式	資本 財・サー ビス	5,500	2,200.76 12,104,213	1,871.98 10,295,912	1.55
24	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消 費財・ サービ ス	500	20,001.30 10,000,650	18,135.15 9,067,575	1.37
25	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	21,000	441.62 9,274,095	422.96 8,882,231	1.34
26	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	6,000	1,494.32 8,965,974	1,406.20 8,437,257	1.27
27	POSCO	韓国	株式	素材	330	31,341.75 10,342,778	25,360.50 8,368,965	1.26
28	CSL LTD	オースト リア	株式	ヘルス ケア	400	23,983.58 9,593,433	20,801.65 8,320,663	1.26
29	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	台湾	株式	資本 財・サー ビス	2,000	3,549.51 7,099,030	3,964.24 7,928,490	1.20
30	CAPITALAND INVESTMENT LTD	シンガ ポール	株式	不動産	23,900	293.85 7,023,938	298.02 7,122,798	1.08

(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	96.41%
合計	96.41%

(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	2.04%
素材	7.08%
資本財・サービス	4.26%
一般消費財・サービス	9.40%
生活必需品	1.69%
ヘルスケア	1.26%

金融	35.63%
情報技術	30.46%
コミュニケーション・サービス	2.24%
不動産	2.35%
合計	96.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

#### (1) 投資状況（2022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	15,077,137,190	98.28
内 日本	15,077,137,190	98.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	263,465,585	1.72
純資産総額	15,340,602,775	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（2022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	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	243,500	1,993.50 485,417,250	2,245.50 546,779,250	3.56
2	日立	日本	株式	電気機 器	88,500	6,683.00 591,445,500	5,939.00 525,601,500	3.43

3	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	153,300	3,203.37 491,077,396	3,267.00 500,831,100	3.26
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	690,400	663.49 458,079,986	691.10 477,135,440	3.11
5	東京海上HD	日本	株式	保険業	67,300	6,153.00 414,096,900	6,830.00 459,659,000	3.00
6	オリックス	日本	株式	その他 金融業	181,800	2,198.50 399,687,300	2,355.50 428,229,900	2.79
7	伊藤忠	日本	株式	卸売業	112,700	3,409.64 384,267,550	3,667.00 413,270,900	2.69
8	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	108,600	3,733.00 405,403,800	3,645.00 395,847,000	2.58
9	三菱商事	日本	株式	卸売業	101,700	3,684.79 374,743,744	3,877.00 394,290,900	2.57
10	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	95,400	3,867.00 368,911,800	4,113.00 392,380,200	2.56
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	6,600	49,550.00 327,030,000	54,730.00 361,218,000	2.35
12	しまむら	日本	株式	小売業	34,300	9,777.80 335,378,647	10,460.00 358,778,000	2.34
13	富士電機	日本	株式	電気機 器	57,100	5,020.00 286,642,000	6,090.00 347,739,000	2.27
14	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	43,200	9,229.00 398,692,800	7,630.00 329,616,000	2.15
15	大日本印刷	日本	株式	その他 製品	119,900	2,826.00 338,837,400	2,747.00 329,365,300	2.15
16	AGC	日本	株式	ガラス・ 土石製 品	61,400	5,781.53 354,985,979	5,230.00 321,122,000	2.09
17	旭化成	日本	株式	化学	260,200	1,220.31 317,525,336	1,121.00 291,684,200	1.90
18	デクセリアルズ	日本	株式	化学	85,700	2,136.00 183,055,200	3,120.00 267,384,000	1.74
19	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	29,800	7,969.11 237,479,545	8,494.00 253,121,200	1.65
20	プレミアグループ	日本	株式	その他 金融業	60,400	3,235.00 195,394,000	3,610.00 218,044,000	1.42
21	MS & AD	日本	株式	保険業	52,200	3,729.00 194,653,800	3,926.00 204,937,200	1.34

22	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	78,900	2,443.00 192,752,700	2,571.50 202,891,350	1.32
23	東レ	日本	株式	繊維製 品	244,000	739.26 180,381,732	725.10 176,924,400	1.15
24	豊田自動織機	日本	株式	輸送用 機器	19,000	9,680.36 183,926,923	8,900.00 169,100,000	1.10
25	信越化学	日本	株式	化学	8,800	19,695.00 173,316,000	19,040.00 167,552,000	1.09
26	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	184,600	889.00 164,109,400	878.00 162,078,800	1.06
27	トヨタ紡織	日本	株式	輸送用 機器	79,900	2,348.79 187,668,652	2,022.00 161,557,800	1.05
28	住友林業	日本	株式	建設業	79,500	2,315.81 184,107,479	2,000.00 159,000,000	1.04
29	IHI	日本	株式	機械	68,400	2,740.00 187,416,000	2,288.00 156,499,200	1.02
30	アサヒグループホールディ ン	日本	株式	食料品	33,200	5,166.87 171,540,347	4,668.00 154,977,600	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。

#### 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	98.28%
合計	98.28%

(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
建設業	2.80%
食料品	2.10%
繊維製品	2.77%
化学	13.13%
ガラス・土石製品	2.95%
鉄鋼	0.81%
非鉄金属	0.78%
金属製品	1.44%
機械	3.91%
電気機器	10.29%
輸送用機器	8.85%

精密機器	0.54%
その他製品	3.23%
陸運業	1.18%
倉庫・運輸関連業	0.84%
情報・通信業	8.66%
卸売業	10.23%
小売業	4.08%
銀行業	5.67%
証券、商品先物取引業	0.68%
保険業	5.65%
その他金融業	4.21%
不動産業	1.15%
サービス業	2.31%
合計	98.28%

(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)

2022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	19,526円
純資産総額	73億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.2%
3カ月間	-2.2%
6カ月間	-0.3%
1年間	9.7%
3年間	20.8%
5年間	26.9%
設定来	95.3%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第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	第15期	第16期
	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	21年1月	22年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	287	24.8%	日本円	51.3%	直接利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.4%	
外国債券	858	24.6%	米ドル	26.3%	最終利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.4%	
外国リート等	133	15.1%	ユーロ	12.2%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	0.4%	
国内リート・先物	48	14.7%	英ポンド	3.6%	残存年数	日立	日本	0.3%	
国内株式	104	9.7%	豪ドル	2.5%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.3%	
外国株式	158	8.1%	シンガポール・ドル	1.1%	AAA	86.3%	日本ビルファンド	日本	1.1%
			カナダドル	1.0%	AA	6.3%	GLP投資法人	日本	0.8%
			香港ドル	0.5%	A	6.2%	野村不動産マスターF	日本	0.8%
			スイス・フラン	0.4%	BBB	-	日本都市ファンド投資法人	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.4%	その他	1.3%	BB以下・無格付	1.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
合計	1,588	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.1%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.2%保有しております。

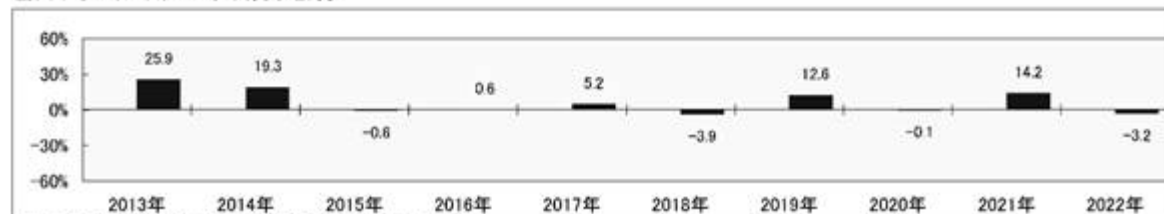
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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。

・2022年は1月31日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【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】(2022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	8,324,311,290	99.12
内 日本	8,324,311,290	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	73,514,096	0.88
純資産総額	8,397,825,386	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】(2022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	1,094,169,564	1.2840 1,404,918,721	1.2803 1,400,865,292	16.68
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	451,291,517	3.1299 1,412,498,263	3.1023 1,400,041,673	16.67
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	413,538,944	3.4715 1,435,638,594	3.3741 1,395,321,750	16.62
4	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	407,524,843	3.5195 1,434,296,162	3.3804 1,377,596,979	16.40
5	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	383,147,984	3.7518 1,437,496,535	3.5829 1,372,780,911	16.35
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	246,560,592	4.5063 1,111,095,540	4.2981 1,059,742,080	12.62
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	126,628,578	2.1899 277,312,572	2.1508 272,352,745	3.24

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	16,020,886	2.9640 47,485,910	2.8469 45,609,860	0.54
---	------------------------------	----	-------------------	------------	----------------------	----------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
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
第15計算期間末 (2021年1月12日)	6,484,800,717	6,484,800,717	1.8830	1.8830
2021年1月末日	6,520,006,792	-	1.8897	-
2月末日	6,718,642,714	-	1.9373	-
3月末日	7,142,468,662	-	2.0287	-
4月末日	7,288,255,621	-	2.0582	-
5月末日	7,474,051,912	-	2.0864	-
6月末日	7,740,397,710	-	2.1160	-
7月末日	7,863,048,565	-	2.1273	-
8月末日	7,978,852,080	-	2.1412	-
9月末日	8,043,474,141	-	2.1279	-
10月末日	8,331,034,151	-	2.1822	-
11月末日	8,309,391,211	-	2.1497	-
12月末日	8,683,144,367	-	2.2161	-
第16計算期間末 (2022年1月11日)	8,604,019,799	8,604,019,799	2.1960	2.1960
2022年1月末日	8,397,825,386	-	2.1343	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第15計算期間	0.3
第16計算期間	16.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第15計算期間	998,812,762	616,961,375
第16計算期間	906,065,649	431,848,512

## (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)

2022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	21,343円
純資産総額	83億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-3.7%
3か月間	-2.2%
6か月間	0.3%
1年間	12.9%
3年間	25.3%
5年間	32.6%
設定来	113.4%

※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	第15期	第16期
	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	21年1月	22年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金は、収益配分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	相入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国リート等	133	17.6%	日本円	51.5%	直接利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%	
国内債券	287	16.5%	米ドル	27.9%	最終利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.7%	
外国債券	858	16.4%	ユーロ	9.9%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	0.6%	
国内リート・先物	48	16.4%	英ポンド	3.6%	残存年数	日立	日本	0.6%	
国内株式	104	16.1%	豪ドル	2.6%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.5%	
外国株式	158	13.5%	シンガポール・ドル	1.2%	AAA	86.3%	日本ビルファンド	日本	1.2%
			カナダドル	1.0%	AA	6.3%	GLP投資法人	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.6%	A	6.2%	野村不動産マスターF	日本	0.9%
			香港ドル	0.6%	BBB	-	日本都市ファンド投資法人	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.7%	その他	1.1%	BB以下・無格付	1.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.8%
合計	1,588	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.8%	

※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1.2%保有しております。

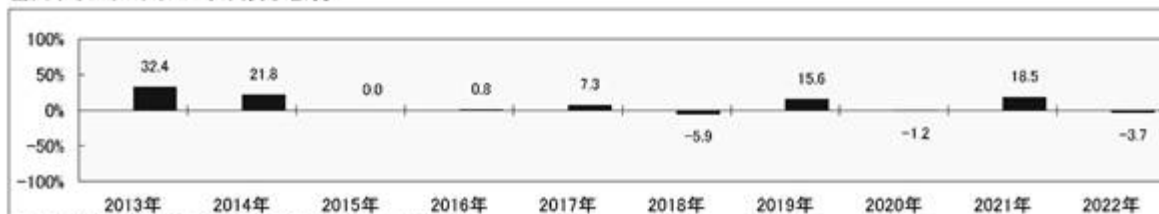
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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。

※2022年は1月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【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】 (2022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	10,157,210,742	99.13
内 日本	10,157,210,742	99.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	89,275,988	0.87
純資産総額	10,246,486,730	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】 (2022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 ダイワ好配当日本株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	748,750,876	3.5196 2,635,303,585	3.3804 2,531,077,461	24.70
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	605,564,958	3.4723 2,102,713,037	3.3741 2,043,236,724	19.94
3 ダイワ・グローバルREIT・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	562,231,686	3.7513 2,109,150,405	3.5829 2,014,419,907	19.66
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	455,602,869	4.5049 2,052,446,672	4.2981 1,958,226,691	19.11
5 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	400,545,317	1.2840 514,303,585	1.2803 512,818,169	5.00
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	165,077,138	3.1299 516,677,622	3.1023 512,118,805	5.00
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	233,068,607	2.1900 510,420,252	2.1508 501,283,959	4.89

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	29,515,974	2.9640 87,485,349	2.8469 84,029,026	0.82
---	------------------------------	----	-------------------	------------	----------------------	----------------------	------

(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	99.13%
合計	99.13%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

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
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
第15計算期間末 (2021年1月12日)	7,237,633,493	7,237,633,493	2.0216	2.0216
2021年1月末日	7,291,917,951	-	2.0262	-
2月末日	7,616,595,946	-	2.1011	-
3月末日	8,220,034,138	-	2.2268	-
4月末日	8,465,603,734	-	2.2662	-
5月末日	8,882,523,618	-	2.3036	-
6月末日	9,233,039,897	-	2.3462	-
7月末日	9,395,715,903	-	2.3565	-
8月末日	9,636,677,727	-	2.3787	-
9月末日	9,715,577,010	-	2.3697	-
10月末日	10,119,926,301	-	2.4403	-
11月末日	10,040,202,781	-	2.3957	-
12月末日	10,646,065,558	-	2.4945	-
第16計算期間末 (2022年1月11日)	10,544,787,720	10,544,787,720	2.4728	2.4728
2022年1月末日	10,246,486,730	-	2.3841	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第15計算期間	0.8
第16計算期間	22.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第15計算期間	1,060,242,411	584,120,737
第16計算期間	1,096,214,144	412,115,894

## (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)

2022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	23,841円
純資産総額	102億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.4%
3カ月間	-2.3%
6カ月間	1.2%
1年間	17.7%
3年間	32.9%
5年間	42.2%
設定来	138.4%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第5期 11年1月	第6期 12年1月	第7期 13年1月	第8期 14年1月	第9期 15年1月	第10期 16年1月	第11期 17年1月	第12期 18年1月	第13期 19年1月	第14期 20年1月	第15期 21年1月	第16期 22年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金は、収益配分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	104	24.3%	日本円	51.8%	直接利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.0%
外国リート等	133	21.8%	米ドル	30.1%	最終利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	1.0%
外国株式	158	20.5%	ユーロ	6.7%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	0.9%
国内リート・先物	48	19.7%	英ポンド	3.7%	残存年数	日立	日本	0.8%
国内債券	287	5.0%	豪ドル	3.0%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.8%
外国債券	858	4.9%	シンガポール・ドル	1.3%	AAA	日本ビルファンド	日本	1.5%
			カナダドル	1.0%	AA	GLP投資法人	日本	1.1%
			スイス・フラン	0.9%	A	野村不動産マスターF	日本	1.1%
			香港ドル	0.7%	BBB	日本都市ファンド投資法人	日本	1.0%
コール・ローン、その他		4.2%	その他	0.8%	BB以下・無格付	ジャパンリアルエステイト	日本	1.0%
合計	1,588	-	合計	100.0%	合計	合計		10.3%

※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1.2%保有しております。

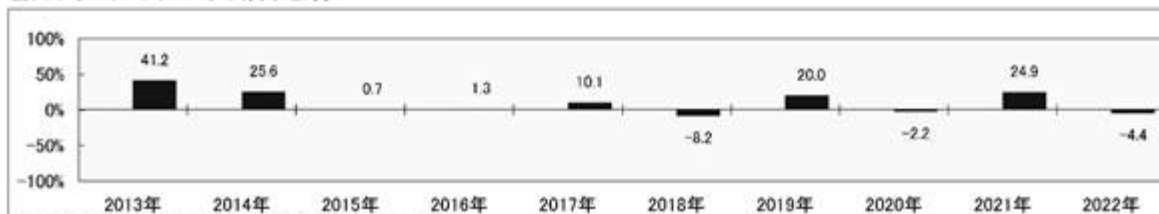
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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。

・2022年は1月31日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

<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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター) 0120-106212(営業日の9:00~17:00)  
ホームページ <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、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
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、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 公告

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

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



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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

##### < 収益分配金にかかる請求権 >

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### < 償還金にかかる請求権 >

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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16期計算期間（2021年1月13日から2022年1月11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/安定コース)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	81,799,886	102,247,468
親投資信託受益証券	5,787,677,732	7,410,201,117
未収入金	5,331,000	4,946,000
流動資産合計	5,874,808,618	7,517,394,585
資産合計	5,874,808,618	7,517,394,585
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,379,643	4,150,367
未払受託者報酬	1,524,940	1,980,067
未払委託者報酬	25,924,802	33,661,828
その他未払費用	228,659	296,931
流動負債合計	36,058,044	40,089,193
負債合計	36,058,044	40,089,193
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,298,446,758	1 3,743,206,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,540,303,816	3,734,098,495
(分配準備積立金)	794,784,674	1,434,811,548
元本等合計	5,838,750,574	7,477,305,392
純資産合計	5,838,750,574	7,477,305,392
負債純資産合計	5,874,808,618	7,517,394,585

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	2020年1月11日 至 2021年1月12日	自	2021年1月13日 至 2022年1月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		268		17
有価証券売買等損益		116,700,243		848,486,385
営業収益合計		116,700,511		848,486,402
<b>営業費用</b>				
支払利息		22,969		20,485
受託者報酬		2,832,399		3,721,740
委託者報酬		1 48,152,274		1 63,270,843
その他費用		425,241		558,131
営業費用合計		51,432,883		67,571,199
営業利益		65,267,628		780,915,203
経常利益		65,267,628		780,915,203
当期純利益		65,267,628		780,915,203
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（ ）		34,314,381		55,728,446
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,131,406,329		2,540,303,816
剰余金増加額又は欠損金減少額		653,758,242		780,584,918
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		653,758,242		780,584,918
剰余金減少額又は欠損金増加額		344,442,764		311,976,996
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		344,442,764		311,976,996
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,540,303,816		3,734,098,495

## (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16期	
	自 2021年1月13日	至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年1月12日としており、2022年1月10日が休日のため、当計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首元本額	2,794,039,123円	3,298,446,758円
期中追加設定元本額	963,521,848円	842,864,166円
期中一部解約元本額	459,114,213円	398,104,027円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,298,446,758口	3,743,206,897口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日	自 2021年1月13日 至 2022年1月11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	6,401,998円	8,386,498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(99,590,309円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,995,605,114円)及び分配準備積立金(695,194,365円)より分配可能額は2,790,389,788円(1万口当たり8,459.71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(725,187,318円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,457,016,855円)及び分配準備積立金(709,624,230円)より分配可能額は3,891,828,403円(1万口当たり10,397.04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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11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16期 2022年1月11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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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	129,952,953	803,613,428
合計	129,952,953	803,613,428

## (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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7702円 (17,702円)	1.9976円 (19,976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	586,462,829	1,835,687,301	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド（BPI）	1,429,239,873	1,835,143,996	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	301,604,602	1,131,680,787	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	214,965,887	756,593,935	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	129,184,441	582,285,949	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	67,165,600	147,092,664	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	8,505,757	25,211,063	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	315,250,826	1,096,505,422	
親投資信託受益証券 合計			7,410,201,117	
合計			7,410,201,117	

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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	808,209,810	782,658,662
コール・ローン	1,190,976,152	1,286,220,555
国債証券	210,809,825,116	231,934,468,036
派生商品評価勘定	3,923,781	1,902,825
未収利息	1,316,013,992	1,353,281,206
前払費用	39,582,701	36,436,849
流動資産合計	214,168,531,552	235,394,968,133
資産合計	214,168,531,552	235,394,968,133
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,029,163	1,263,734
未払金	398,271	399,440,008
未払解約金	64,770,905	199,582,825
流動負債合計	67,198,339	600,286,567
負債合計	67,198,339	600,286,567
純資産の部		
元本等		
元本	1	70,827,785,140
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		143,273,548,073
元本等合計		234,794,681,566

純資産合計	214,101,333,213	234,794,681,566
負債純資産合計	214,168,531,552	235,394,968,133

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
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	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	67,069,648,143円	70,827,785,140円
期中追加設定元本額	13,637,218,460円	9,881,422,933円
期中一部解約元本額	9,879,081,463円	5,696,965,086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	602,461,239円	497,480,595円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	12,073,691円	10,741,549円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	102,820,108円	71,508,203円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	29,649,083円	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	335,728,560円	304,102,439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)	101,745,014円	222,045,894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)	470,402,250円	512,186,914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)	1,857,026,512円	2,289,368,180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)	676,573,763円	851,881,157円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	948,935円	771,687円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,138,009円	7,731,046円
i F r e e 外国債券イン デックス	988,266,664円	1,788,987,761円
i F r e e 8資産バランス	1,032,007,540円	1,472,160,256円
i F r e e 年金バランス	73,460,835円	245,115,565円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,824,975,540円	49,880,649,200円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	832,230,744円	987,056,953円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	473,441,226円	616,438,540円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	291,976,212円	400,595,480円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	471,628,775円	586,462,829円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	348,917,972円	448,579,124円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	116,184,508円	164,219,760円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	20,967,274円	29,810,808円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,169,837円	11,141,715円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	177,823,083円	654,595,522円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,152,607円	3,467,222円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,016,919円	1,435,829円
ダイワつみたてインデックス バランス70	1,041,435円	1,957,134円

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	- 円	317,987円
ダイワ世界バランスファンド40VA	176,190,863円	161,809,831円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,140,957円	137,986,860円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,233,822,499円	3,827,374,287円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	248,882,370円	229,414,922円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,743,446円	143,556,023円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,452,799円	43,893,681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)	2,015,730,533円	2,454,002,847円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,878,588,200円	5,815,822,364円
ダイワライフスタイル25	33,238,853円	33,076,799円
ダイワライフスタイル50	60,572,925円	65,158,726円
ダイワライフスタイル75	16,593,360円	17,313,358円
計	70,827,785,140円	75,012,242,987円
2. 期末日における受益権の総数	70,827,785,140口	75,012,242,987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 2021年1月13日 至 2022年1月11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>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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11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	2,281,627,082	5,111,074,474
合計	2,281,627,082	5,111,074,474

(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(2020年12月1日から2021年1月12日まで、及び2021年12月1日から2022年1月11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	2021年1月12日 現在				2022年1月11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	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618	1,063,950,821	-	1,064,589,912	639,091
アメリカ・ドル	475,790,631	-	479,528,400	3,737,769	705,112,688	-	706,522,137	1,409,449
イギリス・ポ ン ド	21,131,788	-	21,277,410	145,622	-	-	-	-
シンガポール ・ドル	-	-	-	-	32,163,335	-	32,165,116	1,781
ユーロ	618,374,023	-	616,385,250	1,988,773	326,674,798	-	325,902,659	772,139
合計	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618	1,063,950,821	-	1,064,589,912	639,091

(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)

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,0228円 (30,228円)	3,1301円 (31,301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	2% United States Treasury Note/Bond 20230215	アメリカ・ドル 4,350,000.000	アメリカ・ドル 4,420,165.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,752,136.050	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,693,437.280	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,192,969.250	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,424,460.020	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,081,021.920	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	711,244.620	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,010,900.700	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	887,852.340	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	908,315.640	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	966,349.020	



5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,132,210.000	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,569,125.040	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,195,718.370	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	731,580.000	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	703,078.920	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,273,874.130	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,489,001.880	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,449,995.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,633,584.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,405,556.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,274,931.720	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,391,025.000	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,964,097.070	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,783,815.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,860,071.850	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,917,518.340	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,684,262.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,888,879.860	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,548,021.420	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,455,840.180	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,793,880.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,057,635.620	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,579,505.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,031,288.060	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,661,723.860	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,160,602.840	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,046,696.640	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,363,928.740	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,260,980.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,097,445.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,159,602.520	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,874,457.270	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,715,754.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,943,060.520	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,270,314.250	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,872,217.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	2,120,292.190	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,023,843.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	763,306.520	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,070,374.400	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,902,105.720	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,594,293.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,348,181.320	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	2,994,256.180	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,662,200.860	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,771,818.660	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,096,268.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	3,002,740.410	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,532,500.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,028,920.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,396,166.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,825,369.600	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,802,684.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,422,488.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,528,471.850	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,415,487.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,534,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,708,470.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,548,066.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,565,525.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,763,978.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,546,637.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,845,000.000	3,316,416.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,356,580.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,662,476.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,659,456.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,335,620.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,067,380.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,419,038.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,455,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,103,255.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,078,390.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	3,301,227.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,040,540.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,565,700.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,689,915.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,799,600.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,604,860.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,284,608.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,885,624.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,568,495.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,753,288.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,377,319.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,698,696.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,825,712.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,460,516.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,966,932.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,024,381.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,047,182.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,969,690.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,568,825.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,998,116.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,732,186.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,571,675.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,569,800.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,145,050.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	3,969,080.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,195,666.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	4,965,083.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,634,550.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,713,760.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,774,060.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,647,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,105,090.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,648,825.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,144,520.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,039,919.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,685,662.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,166,860.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,074,520.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,665,130.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,583,200.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,003,194.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,127,000.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,616,400.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,552,204.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,604,100.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,398,604.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,579,875.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,377,632.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,078,542.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,597,475.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,904,552.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,082,500.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,557,960.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,846,592.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,589,980.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,542,375.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,674,620.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,721,440.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,784,236.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,013,560.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,512,300.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,028,710.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,009,100.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,014,760.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,875,096.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,743,270.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,010,000.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,026,820.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,527,925.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,539,825.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,040,280.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,707,429.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,270,902.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,921,050.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,192,736.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,258,250.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	293,694.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,180,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,198,194.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,464,075.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,185,344.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,526,240.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,135,128.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,474,695.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,620,458.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,270,808.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,548,656.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,226,550.000	



0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,304,490.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,895,000.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,465,405.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,228,125.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,301,200.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	990,820.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,271,140.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,443,460.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,118,700.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,678,900.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,616,476.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,054,040.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,291,610.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,977,260.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,235,905.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,729,040.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,361,610.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,147,332.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,614,222.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,110,472.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,831,840.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,750,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	6,062,064.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,481,217.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,898,346.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,715,200.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,956,260.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,709,750.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	959,530.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,694,016.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,936,400.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,635,720.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,585,176.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,150,341.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,915,600.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,991,700.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,790,200.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,849,200.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,488,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,883,960.000	

0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,990,300.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,968,500.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,982,420.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	7,000,000.000	6,828,780.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,880,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,956,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	8,608,911.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,007,129.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,364,640.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,376,880.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,849,520.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	6,772,992.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,855,784.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	992,180.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,895,920.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,260,740.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,960,920.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,486,980.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,865,200.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,864,450.000	

0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,403,310.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,943,960.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	9,835,264.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	6,729,639.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	3,457,169.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,475,275.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,769,360.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,783,950.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,967,060.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,819,100.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,830,850.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,350,225.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,797,070.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,397,450.000	
0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,485,405.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,971,160.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	2,000,000.000	1,975,840.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	7,000,000.000	6,746,740.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	4,300,000.000	4,078,593.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	3,000,000.000	2,925,810.000	

	0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,965,280.000	
	1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,869,680.000	
	1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	4,000,000.000	3,925,600.000	
	1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,948,720.000	
	0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,965,000.000	
	1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	2,400,000.000	2,366,616.000	
	1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,187,526.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 954,492,742.250 (110,091,192,892)	
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	921,000.000	957,692.640	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,459,151.280	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,502,855.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	1,999,771.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,528,865.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,070,205.600	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,431,093.600	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,004,350.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,559,910.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	990,000.000	1,202,632.200	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,808,316.000	

1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,323,752.100	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	925,658.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	787,976.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,885,788.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,160,964.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,287,051.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,154,410.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	591,382.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,452,660.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,516,720.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	921,470.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,183,130.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,281,449.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,190,306.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	448,300.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	485,315.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	294,213.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	98,003.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	576,462.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	100,000.000	96,005.000	

0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	288,315.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	316,689.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	100,000.000	97,830.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,262,805.830	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,904,899.200	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,658,576.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,295,155.520	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,060,998.030	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,465,557.640	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,193,085.680	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,460,117.120	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	3,792,250.240	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	2,091,488.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,253,768.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,105,809.800	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,147,496.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,173,214.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,333,628.830	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,498,409.600	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	2,528,299.380	

	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,621,122.860	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	2,562,547.680	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,145,955.720	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,444,407.880	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 87,888,287.690 (13,765,942,501)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	2,277,360.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,300,000.000	1,366,937.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	2,980,834.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,155,880.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,403,615.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,917,792.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,051,048.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,957,644.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,537,395.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,373,888.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,602,336.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,612,365.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	2,001,060.000	



	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	199,164.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	901,701.000	
イスラエル・シケル 小計			イスラエル・シケル 28,339,019.000 (1,042,345,960)	
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	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	468,000.000	498,050.280	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,313,604.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,063,975.030	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,754,000.000	1,934,819.860	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,915,822.940	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,583,847.160	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,954,421.320	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,334,620.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,408,109.520	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	893,906.640	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,780,228.560	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,219,453.820	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,353,324.360	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,920,258.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,033,893.000	

	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	3,019,641.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,452,953.100	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,745,768.800	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,218,789.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,349,840.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,800,000.000	2,600,024.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,164,744.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,534,080.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,298,950.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,147,176.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,079,573.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 44,819,875.550 (3,716,912,280)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,323,864.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,139,100.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	3,500,000.000	3,442,670.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	5,000,000.000	5,046,800.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,173,310.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	3,800,000.000	3,853,846.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,519,575.000	

	3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,320,870.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,778,850.000	
	3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,309,350.000	
	3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	5,000,000.000	5,195,250.000	
	4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	3,100,000.000	3,480,153.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20230520	10,000,000.000	10,031,600.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,538,005.000	
	3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,617,775.000	
	2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	4,000,000.000	4,029,360.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 84,800,378.000 (1,533,122,994)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	726,484.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,267,647.310	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,562,895.230	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,429,338.680	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,216,974.220	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,245,292.630	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,262,084.250	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,447,782.250	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,559,008.850	

2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,190,229.160	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	970,889.550	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,207,239.200	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	667,452.500	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,340,678.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,320,397.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,742,462.500	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,277,218.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,227,972.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,409,590.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,346,603.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	697,977.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,797,780.100	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,806,400.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,998,654.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,175,832.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,489,755.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,089,957.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	293,166.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,336,624.000	

	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	98,816.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	985,810.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,000,000.000	941,750.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	989,750.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	196,940.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	500,000.000	496,075.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	292,647.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 51,106,171.930 (4,654,750,139)	
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	843,178.400	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	968,227.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	876,956.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	439,528.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	690,861.600	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	649,508.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	672,500.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	543,597.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	755,424.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	462,600.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	767,362.500	

	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	455,355.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	581,075.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	500,731.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	363,300.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	659,590.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	726,375.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	300,000.000	294,930.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	186,812.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	197,506.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,635,417.100 (990,406,703)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	6,811,801.150	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,270,886.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,216,574.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,449,752.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,195,187.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,901,194.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,629,104.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,886,720.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 51,361,220.050	

			(650,746,658)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 13,662,000.000	デンマーク・クローネ 24,028,862.220	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,034,315.560	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,494,641.300	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,202,570.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	9,988,176.800	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	3,361,680.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	493,705.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	1,013,270.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 58,617,220.880 (1,029,904,571)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	ノルウェー・クローネ 8,204,000.000	ノルウェー・クローネ 8,295,556.640	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,230,749.250	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,421,165.750	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,312,527.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,458,010.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,553,900.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,837,218.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	6,562,884.000	

	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,323,250.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 43,995,261.440 (572,378,351)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,110,878.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,927,019.500	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,813,540.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,798,393.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,425,938.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,271,786.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,812,080.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,405,850.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	956,650.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	1,300,000.000	1,089,530.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	921,278.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,642,850.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,400,157.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,492,523.050	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 39,068,474.450 (1,124,441,484)	
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	2,373,000.000	2,397,560.550	
4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,249,445.700	
4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,588,882.440	
4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,352,676.000	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	753,872.990	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,015,944.930	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,423,560.930	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,914,308.860	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,425,372.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,094,639.770	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,791,750.240	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,252,464.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,330,578.900	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	989,073.600	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,593,353.500	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,601,630.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,226,913.800	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,125,266.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,234,284.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,732,606.000	

	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,285,956.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	655,632.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	670,098.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,610,000.000	2,665,932.300	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,303,368.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	405,928.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,280,695.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,653,522.500	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,650,000.000	1,602,496.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,651,734.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 42,269,547.210 (1,160,848,575)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,758,754.800	
	8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	18,895,858.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	24,013,724.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,147,540.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	3,000,000.000	2,719,170.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	924,960.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	30,276,567.630	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	25,383,560.370	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	27,703,143.040	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,474,603.380	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	30,800,801.760	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	19,620,474.300	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	25,515,000.000	25,418,298.150	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	18,800,426.780	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,870,279.680	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ	

			294,808,161.890 (1,669,822,910)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	385,435.960	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	292,352.940	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	841,088.100	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	707,154.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	434,966.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	832,664.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	737,087.100	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	520,175.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	520,290.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	202,902.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	297,249.700	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	383,512.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	496,110.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	347,964.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	597,612.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	202,676.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,458,675.200	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,181,759.520	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	940,933.280	

1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	295,759.200	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	908,721.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,330,201.600	
2.1% Austria Government Bond 21170920	590,000.000	881,507.200	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,265,724.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,016,573.600	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	811,136.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	973,434.000	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,008,240.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	705,397.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	359,916.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	293,968.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,180,836.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	486,288.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	578,628.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,771,258.470	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,908,149.880	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,273,059.660	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,971,873.720	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,438,760.640	

2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	878,809.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	953,432.600	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,161,358.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,080,198.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	790,551.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	676,584.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,579,727.800	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	721,500.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,602,045.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	828,177.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,220,073.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	809,844.800	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,212,540.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,558,096.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	680,000.000	552,377.600	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,108,665.240	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,614,649.530	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,948,513.980	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,268,307.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,981,674.280	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,245,718.240	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,710,427.650	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,722,456.080	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,301,498.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,249,564.960	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,574,000.000	4,233,560.760	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,301,406.720	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,443,938.700	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,869,529.470	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,667,229.330	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,640,002.210	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,197,832.260	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,673,524.660	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,210,430.140	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,264,997.840	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,302,452.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,459,949.440	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,465,229.800	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,333,098.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,408,790.000	

1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	3,507,124.700	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,995,190.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,210,918.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,280,476.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,051,900.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	2,093,040.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,778,507.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	2,079,399.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,038,160.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,825,776.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,223,088.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	909,954.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,377,614.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	2,036,740.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,034,583.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	2,600,000.000	2,620,462.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	707,133.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,007,480.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,008,980.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	101,053.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	700,000.000	641,963.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	200,000.000	202,316.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,777,501.700	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,922,420.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,946,803.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,727,200.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,440,176.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,340,733.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	101,995.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,240,348.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,323,608.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,219,210.150	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,766,609.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,669,213.760	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	5,112,858.800	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,146,045.750	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,289,948.200	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,684,946.540	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,434,637.260	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	6,208,977.760	



4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,356,666.320	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,244,016.920	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,673,585.990	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	3,951,513.680	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,179,377.370	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,424,371.580	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,113,047.900	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,214,348.630	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,598,191.720	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,367,629.270	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,920,000.000	6,631,288.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,537,210.880	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	4,575,602.570	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,719,741.300	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	4,145,985.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,072,435.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,618,994.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,626,511.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,418,480.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,637,556.000	

1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,332,241.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,219,923.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,440,596.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,387,190.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,506,861.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,830,000.000	3,880,364.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,175,472.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,417,616.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,617,871.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,037,020.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	2,124,364.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,936,240.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	748,396.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,132.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,000,000.000	945,020.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	4,474,880.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	1,600,000.000	1,614,448.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	700,000.000	654,801.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	593,368.920	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,535,759.260	

4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,429,189.900	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	826,555.450	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,906,621.900	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,852,836.200	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,435,510.950	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	3,073,745.760	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,611,274.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,833,554.160	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	2,012,787.420	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,325,114.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,416,618.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,434,591.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,231,452.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	940,158.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,402,674.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	811,368.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,050,000.000	935,476.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,293,123.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	859,824.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	600,000.000	604,332.000	

9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,056,477.540	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,469,995.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,188,105.440	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,939,764.620	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,868,036.370	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,597,298.450	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,139,814.950	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,016,543.490	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,823,518.200	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,380,662.460	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,510,573.060	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,522,004.800	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,108,146.120	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,574,025.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,048,256.880	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,668,810.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,640,026.100	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,357,655.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,375,511.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,910,033.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,661,712.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,532,011.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,261,826.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,929,108.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,354,600.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,889,277.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,302,344.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,682,199.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,543,558.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	2,262,925.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,189,313.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,293,478.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,258,025.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,498,850.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,947,063.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	743,729.600	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,308,632.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,387,294.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,659,740.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,477,965.000	

0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,028,000.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,429,214.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,976,160.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	2,188,956.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,312,142.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,236,960.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,710,200.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,481,400.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,241,350.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,102,530.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	1,091,604.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	634,214.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,842,753.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,700,000.000	2,547,801.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	641,046.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,081,729.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,500,540.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	417,390.200	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	784,656.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,843,076.000	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	998,410.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	500,000.000	500,885.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	1,076,581.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	100,000.000	96,213.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	100,000.000	96,900.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	298,725.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	4,323,980.280	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,080,024.410	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,629,163.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,228,988.740	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,599,976.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,043,679.520	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,428,468.840	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,439,808.920	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,384,148.680	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,424,777.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,027,369.700	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,015,121.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,750,520.430	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,408,353.800	

3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,416,389.860	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,774,530.100	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,317,430.400	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	3,029,892.320	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,621,641.760	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,210,549.340	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,079,543.400	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,394,262.900	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,370,827.590	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,622,691.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	983,970.810	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,221,683.450	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	657,215.520	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	659,450.870	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,140,755.050	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	1,173,572.050	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,132,755.370	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	636,933.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	847,968.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	820,515.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	828,150.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,021,098.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	796,103.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	342,013.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	814,096.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	798,288.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	773,472.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	385,496.000	



6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,124,937.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,139,367.410	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,069,337.500	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	680,995.640	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	970,945.500	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,000,073.970	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	968,129.280	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	989,373.920	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	772,045.830	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	463,069.490	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	457,988.480	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	580,235.480	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	560,671.230	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,734,016.000	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,172,587.550	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,311,249.680	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,388,753.920	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,972,656.770	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,610,312.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,313,793.500	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,803,027.700	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,048,257.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,058,420.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,208,116.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,583,360.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,687,985.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,432,568.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	3,130,463.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,734,416.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,070,353.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,336,271.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,856,364.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,369,302.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,478,007.200	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,523,375.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	1,254,246.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,491,560.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,088,355.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,301,196.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	502,055.000	

0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,106,302.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	302,547.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	560,631.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	494,475.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	870,372.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,874,540.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	579,750.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	300,000.000	299,460.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,318,725.950	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,289,036.800	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,554,377.060	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,865,825.780	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,210,702.360	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,277,298.120	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,502,682.950	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,081,588.960	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,069,523.650	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,361,746.400	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,318,156.430	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,163,276.700	

	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,282,815.170	
	ユーロ 小計		ユーロ 688,076,909.100 (89,931,652,018)	
国債証券	合計		231,934,468,036 [231,934,468,036]	
合計			231,934,468,036 [231,934,468,036]	

- (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 258銘柄	100%	47.6%
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	100%	5.9%
イスラエル・シケル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 16銘柄	100%	0.7%
カナダ・ドル	国債証券 36銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 348銘柄	100%	38.8%

## 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

「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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,467,266	187,747,349
国債証券	22,192,881,490	33,228,681,850
地方債証券	1,557,570,200	1,661,017,000
特殊債券	832,608,000	832,738,000
社債券	927,958,500	1,321,353,100
未収利息	38,592,254	47,155,585
前払費用	1,516,499	1,712,564
流動資産合計	25,722,594,209	37,280,405,448
資産合計	25,722,594,209	37,280,405,448
負債の部		
流動負債		
未払金	65,432,580	-
未払解約金	2,455,801	1,307,834
流動負債合計	67,888,381	1,307,834
負債合計	67,888,381	1,307,834
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,879,992,868	29,034,289,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,774,712,960	8,244,808,531
元本等合計	25,654,705,828	37,279,097,614
純資産合計	25,654,705,828	37,279,097,614
負債純資産合計	25,722,594,209	37,280,405,448

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	16,028,287,542円	19,879,992,868円
期中追加設定元本額	6,073,950,287円	9,440,596,151円
期中一部解約元本額	2,222,244,961円	286,299,936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）	373,114,786円	835,787,692円
i F r e e 日本債券イン デックス	1,030,746,206円	3,554,950,837円
i F r e e 8 資産バランス	2,420,708,041円	3,591,914,229円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	7,126,335,088円	8,822,756,090円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,423,063,248円	6,013,737,455円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,368,806,867円	1,953,751,471円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	1,101,820,763円	1,429,239,873円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6 分散コー ス）	815,724,660円	1,094,214,275円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	271,665,036円	400,305,943円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	422,319,928円	797,503,964円

ダイワつみたてインデックス バランス30	26,998,895円	30,973,755円
ダイワつみたてインデックス バランス50	9,495,392円	14,028,003円
ダイワつみたてインデックス バランス70	4,868,661円	9,541,751円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	293,760,030円	282,914,962円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	190,565,267円	202,668,783円
計	19,879,992,868円	29,034,289,083円
2. 期末日における受益権の総数	19,879,992,868口	29,034,289,083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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11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	35,194,870	251,973,650
地方債証券	1,514,300	8,123,000
特殊債券	960,300	3,543,700
社債券	818,200	5,070,200
合計	38,487,670	268,710,550

(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(2020年12月1日から2021年1月12日まで、及び2021年12月1日から2022年1月11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

2021年1月12日現在	2022年1月11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)

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2905円	1.2840円
(1万口当たり純資産額)	(12,905円)	(12,840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	4 2 1	2年国債	130,000,000	130,260,000	
	4 2 2	2年国債	240,000,000	240,501,600	
	4 2 3	2年国債	30,000,000	30,032,700	
	4 2 4	2年国債	150,000,000	150,175,500	
	4 2 5	2年国債	130,000,000	130,161,200	
	4 2 6	2年国債	60,000,000	60,079,200	
	4 2 7	2年国債	90,000,000	90,125,100	
	4 2 8	2年国債	170,000,000	170,249,900	
	4 2 9	2年国債	180,000,000	180,277,200	
	4 3 0	2年国債	250,000,000	250,405,000	
	1 3 5	5年国債	420,000,000	420,919,800	
	1 3 6	5年国債	380,000,000	381,007,000	
	1 3 7	5年国債	590,000,000	591,840,800	
	1 3 8	5年国債	560,000,000	562,004,800	
	1 3 9	5年国債	580,000,000	582,343,200	
	1 4 0	5年国債	450,000,000	451,975,500	
	1 4 1	5年国債	520,000,000	522,516,800	
	1 4 2	5年国債	200,000,000	201,030,000	
	1 4 3	5年国債	550,000,000	553,069,000	
	1 4 4	5年国債	400,000,000	402,480,000	
	1 4 5	5年国債	480,000,000	482,923,200	
	1 4 6	5年国債	170,000,000	171,038,700	
	1 4 7	5年国債	406,000,000	406,848,540	
	1 4 8	5年国債	340,000,000	340,676,600	
	1 4 9	5年国債	450,000,000	450,738,000	
	1	40年国債	30,000,000	42,556,200	
	2	40年国債	48,000,000	66,026,400	
	3	40年国債	19,000,000	26,296,760	
	4	40年国債	54,000,000	75,177,180	
	5	40年国債	35,000,000	47,160,400	
	6	40年国債	40,000,000	53,170,800	
	7	40年国債	41,000,000	52,457,860	
	8	40年国債	33,000,000	39,539,610	
	9	40年国債	40,000,000	36,092,400	
	1 0	40年国債	91,000,000	96,002,270	
	1 1	40年国債	85,000,000	87,076,550	
	1 2	40年国債	99,000,000	91,803,690	
	1 3	40年国債	252,000,000	232,953,840	
	1 4	40年国債	225,000,000	221,256,000	

328	10年国債	60,000,000	60,486,600	
329	10年国債	200,000,000	202,528,000	
330	10年国債	81,000,000	82,204,470	
331	10年国債	40,000,000	40,459,600	
332	10年国債	65,000,000	65,857,350	
333	10年国債	83,000,000	84,234,210	
334	10年国債	320,000,000	325,308,800	
335	10年国債	210,000,000	213,280,200	
337	10年国債	300,000,000	303,309,000	
338	10年国債	80,000,000	81,199,200	
339	10年国債	135,000,000	137,184,300	
340	10年国債	190,000,000	193,264,200	
341	10年国債	15,000,000	15,210,000	
342	10年国債	140,000,000	140,849,800	
343	10年国債	270,000,000	271,679,400	
344	10年国債	90,000,000	90,549,000	
345	10年国債	410,000,000	412,632,200	
346	10年国債	250,000,000	251,620,000	
347	10年国債	400,000,000	402,608,000	
348	10年国債	360,000,000	362,354,400	
349	10年国債	250,000,000	251,557,500	
350	10年国債	400,000,000	402,472,000	
351	10年国債	350,000,000	352,138,500	
352	10年国債	390,000,000	392,343,900	
353	10年国債	350,000,000	352,061,500	
354	10年国債	330,000,000	331,890,900	
355	10年国債	320,000,000	321,660,800	
356	10年国債	300,000,000	301,377,000	
357	10年国債	250,000,000	250,987,500	
358	10年国債	360,000,000	361,170,000	
359	10年国債	340,000,000	340,853,400	
360	10年国債	350,000,000	350,602,000	
361	10年国債	330,000,000	330,290,400	
362	10年国債	315,000,000	314,855,100	
363	10年国債	330,000,000	329,382,900	
364	10年国債	355,000,000	353,810,750	
2	30年国債	9,000,000	10,707,660	
3	30年国債	4,000,000	4,744,480	
4	30年国債	8,000,000	9,983,520	

5	30年国債	8,000,000	9,551,920
6	30年国債	9,000,000	10,987,830
7	30年国債	12,000,000	14,622,120
10	30年国債	25,000,000	27,461,250
11	30年国債	9,000,000	10,503,360
12	30年国債	11,000,000	13,371,600
13	30年国債	11,000,000	13,277,440
14	30年国債	22,000,000	27,674,240
15	30年国債	21,000,000	26,746,860
16	30年国債	26,000,000	33,214,480
17	30年国債	17,000,000	21,580,310
18	30年国債	20,000,000	25,200,600
19	30年国債	15,000,000	18,947,850
20	30年国債	16,000,000	20,696,000
21	30年国債	16,000,000	20,321,600
22	30年国債	17,000,000	22,118,190
23	30年国債	16,000,000	20,884,800
24	30年国債	15,000,000	19,628,550
25	30年国債	17,000,000	21,813,890
26	30年国債	32,000,000	41,607,680
27	30年国債	32,000,000	42,294,080
28	30年国債	34,000,000	45,161,180
29	30年国債	43,000,000	56,674,860
30	30年国債	56,000,000	73,166,240
31	30年国債	76,000,000	98,353,880
32	30年国債	45,000,000	59,241,600
33	30年国債	95,000,000	120,486,600
34	30年国債	110,000,000	143,865,700
35	30年国債	120,000,000	152,947,200
36	30年国債	138,000,000	176,434,380
37	30年国債	135,000,000	170,594,100
38	30年国債	85,000,000	105,962,700
39	30年国債	88,000,000	111,635,920
40	30年国債	70,000,000	87,547,600
41	30年国債	65,000,000	80,102,750
42	30年国債	73,000,000	90,042,580
43	30年国債	95,000,000	117,287,000
44	30年国債	75,000,000	92,677,500
45	30年国債	80,000,000	95,576,000

4 6	3 0 年国債	90,000,000	107,579,700	
4 7	3 0 年国債	105,000,000	127,886,850	
4 8	3 0 年国債	110,000,000	129,323,700	
4 9	3 0 年国債	75,000,000	88,204,500	
5 0	3 0 年国債	85,000,000	88,589,550	
5 1	3 0 年国債	95,000,000	88,174,250	
5 2	3 0 年国債	102,000,000	99,166,440	
5 3	3 0 年国債	95,000,000	94,385,350	
5 4	3 0 年国債	100,000,000	103,920,000	
5 5	3 0 年国債	96,000,000	99,686,400	
5 6	3 0 年国債	88,000,000	91,307,040	
5 7	3 0 年国債	90,000,000	93,306,600	
5 8	3 0 年国債	140,000,000	144,860,800	
5 9	3 0 年国債	97,000,000	97,983,580	
6 0	3 0 年国債	80,000,000	84,452,000	
6 1	3 0 年国債	70,000,000	70,398,300	
6 2	3 0 年国債	82,000,000	78,254,240	
6 3	3 0 年国債	85,000,000	78,858,750	
6 4	3 0 年国債	90,000,000	83,350,800	
6 5	3 0 年国債	76,000,000	70,179,920	
6 6	3 0 年国債	115,000,000	106,253,100	
6 7	3 0 年国債	90,000,000	87,553,800	
6 8	3 0 年国債	96,000,000	93,482,880	
6 9	3 0 年国債	106,000,000	105,871,740	
7 0	3 0 年国債	166,000,000	165,598,280	
7 1	3 0 年国債	66,000,000	65,838,960	
7 2	3 0 年国債	203,000,000	202,252,960	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	40,514,000	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,202,240	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	30,810,600	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	36,171,100	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	43,613,220	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	31,094,100	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	19,820,610	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	26,243,750	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	12,570,840	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	19,087,020	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	17,943,670	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	56,104,210	

75	20年国債	14,000,000	14,966,840
76	20年国債	25,000,000	26,567,000
78	20年国債	17,000,000	18,150,220
79	20年国債	14,000,000	14,995,400
81	20年国債	65,000,000	69,948,450
82	20年国債	28,000,000	30,235,240
85	20年国債	31,000,000	33,779,770
86	20年国債	6,000,000	6,588,300
87	20年国債	35,000,000	38,285,100
88	20年国債	33,000,000	36,423,090
89	20年国債	15,000,000	16,489,350
92	20年国債	60,000,000	66,302,400
93	20年国債	18,000,000	19,891,800
94	20年国債	45,000,000	49,963,050
95	20年国債	30,000,000	33,787,200
96	20年国債	63,000,000	70,267,680
97	20年国債	25,000,000	28,152,000
98	20年国債	34,000,000	38,093,260
99	20年国債	53,000,000	59,625,530
100	20年国債	35,000,000	39,761,050
101	20年国債	18,000,000	20,671,200
102	20年国債	10,000,000	11,540,800
103	20年国債	21,000,000	24,100,440
104	20年国債	64,000,000	72,625,920
105	20年国債	38,000,000	43,307,460
106	20年国債	16,000,000	18,341,760
107	20年国債	40,000,000	45,779,200
108	20年国債	68,000,000	76,882,160
109	20年国債	60,000,000	68,091,000
110	20年国債	27,000,000	31,028,400
111	20年国債	35,000,000	40,634,650
112	20年国債	40,000,000	46,142,800
113	20年国債	70,000,000	81,051,600
114	20年国債	45,000,000	52,292,700
115	20年国債	42,000,000	49,138,740
116	20年国債	27,000,000	31,718,250
117	20年国債	77,000,000	89,828,200
118	20年国債	13,000,000	15,110,290
119	20年国債	23,000,000	26,347,650

1 2 0	2 0 年国債	98,000,000	110,620,440	
1 2 3	2 0 年国債	42,000,000	49,506,240	
1 2 4	2 0 年国債	100,000,000	116,985,000	
1 2 5	2 0 年国債	25,000,000	29,777,250	
1 2 6	2 0 年国債	21,000,000	24,630,690	
1 2 7	2 0 年国債	110,000,000	128,016,900	
1 2 8	2 0 年国債	32,000,000	37,349,120	
1 2 9	2 0 年国債	95,000,000	109,992,900	
1 3 0	2 0 年国債	28,000,000	32,488,960	
1 3 1	2 0 年国債	150,000,000	172,612,500	
1 3 2	2 0 年国債	25,000,000	28,822,250	
1 3 3	2 0 年国債	150,000,000	174,403,500	
1 3 4	2 0 年国債	15,000,000	17,482,500	
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	23,109,400	
1 3 6	2 0 年国債	150,000,000	171,814,500	
1 3 7	2 0 年国債	18,000,000	20,834,460	
1 3 9	2 0 年国債	190,000,000	217,969,900	
1 4 0	2 0 年国債	65,000,000	75,399,350	
1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	55,795,200	
1 4 2	2 0 年国債	165,000,000	193,564,800	
1 4 3	2 0 年国債	100,000,000	115,377,000	
1 4 4	2 0 年国債	70,000,000	79,998,100	
1 4 5	2 0 年国債	190,000,000	221,737,600	
1 4 6	2 0 年国債	165,000,000	192,934,500	
1 4 7	2 0 年国債	195,000,000	226,168,800	
1 4 8	2 0 年国債	175,000,000	201,220,250	
1 4 9	2 0 年国債	195,000,000	224,532,750	
1 5 0	2 0 年国債	185,000,000	211,033,200	
1 5 1	2 0 年国債	190,000,000	212,220,500	
1 5 2	2 0 年国債	200,000,000	223,536,000	
1 5 3	2 0 年国債	180,000,000	203,641,200	
1 5 4	2 0 年国債	205,000,000	229,407,300	
1 5 5	2 0 年国債	165,000,000	180,330,150	
1 5 6	2 0 年国債	150,000,000	151,524,000	
1 5 7	2 0 年国債	196,000,000	192,356,360	
1 5 8	2 0 年国債	205,000,000	209,587,900	
1 5 9	2 0 年国債	155,000,000	160,499,400	
1 6 0	2 0 年国債	165,000,000	173,075,100	
1 6 1	2 0 年国債	135,000,000	139,533,300	

	1 6 2	2 0 年国債	175,000,000	180,699,750	
	1 6 3	2 0 年国債	160,000,000	165,040,000	
	1 6 4	2 0 年国債	230,000,000	233,493,700	
	1 6 5	2 0 年国債	155,000,000	157,146,750	
	1 6 6	2 0 年国債	170,000,000	177,559,900	
	1 6 7	2 0 年国債	125,000,000	126,381,250	
	1 6 8	2 0 年国債	155,000,000	153,885,550	
	1 6 9	2 0 年国債	135,000,000	131,512,950	
	1 7 0	2 0 年国債	125,000,000	121,528,750	
	1 7 1	2 0 年国債	130,000,000	126,135,100	
	1 7 2	2 0 年国債	185,000,000	182,371,150	
	1 7 3	2 0 年国債	150,000,000	147,592,500	
	1 7 4	2 0 年国債	195,000,000	191,665,500	
	1 7 5	2 0 年国債	135,000,000	134,882,550	
	1 7 6	2 0 年国債	150,000,000	149,607,000	
	1 7 7	2 0 年国債	128,000,000	125,177,600	
	1 7 8	2 0 年国債	170,000,000	169,090,500	
国債証券 合計				33,228,681,850	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	101,197,700	
	2 7 - 1 5	北海道公債	100,000,000	100,593,500	
	3 - 5	北海道公債	100,000,000	99,322,600	
	2 2 2	神奈川県公債	100,000,000	99,925,200	
	4 0 1	大阪府公債	100,000,000	101,538,300	
	3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	101,610,400	
	1 1	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	113,953,100	
	2 8 - 1	静岡県公債	100,000,000	100,029,600	
	2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	100,764,700	
	9	埼玉県 2 0 年	100,000,000	116,310,100	
	2 2 - 1	福岡県 1 5 年	100,000,000	106,178,100	
	2 9 - 6	千葉県公債	100,000,000	100,779,500	
	1 6 8	共同発行地方	100,000,000	100,677,300	
	2 7 - 1	滋賀県公債	100,000,000	101,584,600	
	2 5 - 6	大阪市公債	100,000,000	101,193,000	
	1 1	名古屋市 2 0 年	100,000,000	115,359,300	
地方債証券 合計				1,661,017,000	
特殊債券	4 7	日本政策投資 C O	100,000,000	106,336,100	
	8 1	政保道路機構	100,000,000	114,474,300	
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	100,870,200	
	2 4 1	政保道路機構	100,000,000	101,466,900	

	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	101,441,800	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,344,600	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,850,800	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	106,953,300	
特殊債券 合計			832,738,000	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,922,000	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	101,308,100	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,203,600	
	1 8 楽天グループ	100,000,000	99,776,500	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,149,900	
	6 楽天カード	100,000,000	100,210,900	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	100,695,100	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,713,100	
	8 0 三菱地所	100,000,000	110,833,500	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	104,756,400	
	9 ソフトバンク	100,000,000	100,241,200	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	102,974,300	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	99,568,500	
社債券 合計			1,321,353,100	
合計			37,043,789,950	

## 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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,300,839,495	2,456,452,366
コール・ローン	293,597,486	2,958,755,265
投資証券	71,396,328,391	99,439,316,741



派生商品評価勘定	16,001	-
未収入金	139,271,654	1,171,981
未収配当金	240,890,128	294,129,454
流動資産合計	74,370,943,155	105,149,825,807
資産合計	74,370,943,155	105,149,825,807
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	46,840	-
未払金	63,754,018	152,433,507
未払解約金	160,219,000	172,820,000
流動負債合計	224,019,858	325,253,507
負債合計	224,019,858	325,253,507
純資産の部		
元本等		
元本	1	28,120,093,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		46,026,829,542
元本等合計		74,146,923,297
純資産合計		74,146,923,297
負債純資産合計		74,370,943,155

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	33,163,733,156円	28,120,093,755円
期中追加設定元本額	539,057,501円	3,308,769,622円
期中一部解約元本額	5,582,696,902円	3,491,832,584円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREI	24,518,016,919円	22,952,455,720円
T・オープン（毎月分配型）		
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	26,764,856円	23,088,121円

安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	13,633,448円	9,160,653円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	11,440,763円	8,582,433円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	61,279,250円	41,200,851円
6資産バランスファンド(分配型)	119,337,671円	81,794,302円
6資産バランスファンド(成長型)	282,534,099円	229,846,740円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,239,966,499円	1,042,949,524円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	36,275,419円	22,940,941円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	2,798,510円	- 円
常陽3分法ファンド	156,851,444円	97,872,159円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	37,765,258円	24,834,133円
ダイワ・グローバルREIT・オープン(為替ヘッジあり/毎月分配型)	- 円	10,526,946円
ダイワ・グローバルREIT・オープン(為替ヘッジなし/資産成長型)	- 円	651,345,414円
ダイワ・グローバルREIT・オープン(為替ヘッジあり/資産成長型)	- 円	351,073,009円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	325,929,946円	301,604,602円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	396,866,111円	383,107,917円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	526,567,569円	558,687,041円
グローバルREITファンド2021-07(適格機関投資家専用)	- 円	881,939,728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)	313,498,363円	223,818,670円

ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り)	24,036,038円	18,404,155円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	26,531,592円	21,797,734円
計	28,120,093,755円	27,937,030,793円
2. 期末日における受益権の総数	28,120,093,755口	27,937,030,793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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資証券	2,490,934,190	4,763,705,784
合計	2,490,934,190	4,763,705,784

(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(2020年9月16日から2021年1月12日まで、及び2021年9月16日から2022年1月11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	2021年1月12日 現在				2022年1月11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	203,069,257	-	203,053,256	16,001	-	-	-	-
アメリカ・ドル	63,797,604	-	63,791,484	6,120	-	-	-	-
イギリス・ポンド	139,271,653	-	139,261,772	9,881	-	-	-	-
買 建	203,069,257	-	203,022,417	46,840	-	-	-	-
アメリカ・ドル	139,271,653	-	139,268,399	3,254	-	-	-	-
ユーロ	63,797,604	-	63,754,018	43,586	-	-	-	-
合計	406,138,514	-	406,075,673	30,839	-	-	-	-

## (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)

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額	2,6368円	3,7522円
(1万口当たり純資産額)	(26,368円)	(37,522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	AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,449	7,073,559.360	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	190,762	30,689,790.560	
		EQUINIX INC	23,487	17,951,818.710	
		AMERICAN TOWER CORP	33,534	8,866,724.940	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	920,057	16,331,011.750	
		KIMCO REALTY CORP	490,972	12,338,126.360	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	180,439	5,958,095.780	
		INVITATION HOMES INC	375,221	15,999,423.440	
		AMERICOLD REALTY TRUST	325,378	9,868,714.740	

	VICI PROPERTIES INC	565,239	16,228,011.690	
	APARTMENT INCOME REIT CO	184,174	9,884,618.580	
	DIGITAL CORE REIT UNITS	4,778,656	5,638,814.080	
	VENTAS INC	175,970	9,347,526.400	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	137,874	6,640,011.840	
	SUN COMMUNITIES INC	72,072	14,054,040.000	
	PROLOGIS INC	162,315	24,837,441.300	
	COUSINS PROPERTIES INC	159,414	6,591,768.900	
	SITE CENTERS CORP	137,129	2,188,578.840	
	DUKE REALTY CORP	501,109	30,141,706.350	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	50,517	17,429,375.340	
	WELLTOWER INC	328,807	28,783,764.780	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	566,458	20,296,190.140	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	99,524	4,658,718.440	
	REALTY INCOME CORP	325,590	23,322,011.700	
	PUBLIC STORAGE	93,505	33,644,969.100	
	REGENCY CENTERS CORP	83,446	6,365,260.880	
	UDR INC	382,378	22,181,747.780	
	AGREE REALTY CORP	58,738	4,054,684.140	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	88,132	14,034,139.680	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	63,980	13,340,469.800	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 438,741,115.400 (50,604,400,250)	
イギリス・ポンド	INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD	1,547,368	3,086,999.160	
	ASSURA PLC	9,613,649	6,676,679.230	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,603,999	2,855,118.220	
	SEGRO PLC	1,091,812	14,324,573.440	
	BRITISH LAND CO PLC	1,477,389	8,128,594.270	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	315,933	2,372,656.830	
	WORKSPACE GROUP PLC	361,727	2,978,821.840	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	653,508	8,822,358.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	245,719	3,943,789.950	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,203,686	3,235,507.960	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,348,035	12,321,872.640	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 68,746,971.540 (10,767,838,152)

オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	2,240,246	25,157,962.580	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	3,599,784	7,919,524.800	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,153,278	13,604,653.920	
	MIRVAC GROUP	6,357,442	18,309,432.960	
	GOODMAN GROUP	2,264,981	54,948,439.060	
	CHARTER HALL GROUP	2,133,311	40,959,571.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,076,265	12,852,080.350	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 173,751,664.870 (14,409,225,568)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	845,748	19,122,362.280	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 19,122,362.280 (1,741,664,757)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	11,043,400	16,012,930.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	9,404,432	18,620,775.360	
	KEPPEL REIT	13,319,800	15,051,374.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,034,577	25,172,885.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 74,857,964.360 (6,371,909,927)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,272,952	11,451,511.360	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 11,451,511.360 (894,248,521)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	454,738	9,047,467.240	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	74,812	5,005,670.920	
	NSI NV	54,911	1,982,287.100	
	ICADE	118,909	7,800,430.400	
	ARGAN	54,690	6,267,474.000	
	GECINA SA	11,832	1,446,462.000	
	KLEPIERRE	704,489	16,160,977.660	



	AEDIFICA	65,888	7,366,278.400	
	COFINIMMO	51,664	7,232,960.000	
	BEFIMMO	53,676	1,808,881.200	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	282,418	10,963,466.760	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	75,166	3,656,825.900	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,171,339	11,399,471.140	
	ユーロ 小計		ユーロ 90,138,652.720 (11,781,121,911)	
	香港・ドル LINK REIT	2,856,792	香港・ドル 193,976,176.800	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 193,976,176.800 (2,868,907,655)	
投資証券	合計		99,439,316,741 [99,439,316,741]	
合計			99,439,316,741 [99,439,316,741]	

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 30銘柄	100%	50.9%
イギリス・ポンド	投資証券 11銘柄	100%	10.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	14.5%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	6.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.9%
ユーロ	投資証券 13銘柄	100%	11.8%
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

該当事項はありません。

## 「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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,328,335,509	2,623,815,473
投資証券 2	91,762,233,400	124,284,274,600
派生商品評価勘定	124,649,740	-
未収入金	784,288,170	552,548,296
未収配当金	603,800,856	736,507,341
流動資産合計	96,603,307,675	128,197,145,710
資産合計	96,603,307,675	128,197,145,710
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,200	4,932,000
前受金	127,984,000	4,800,000
未払金	658,719,029	619,709,383
未払解約金	19,058,000	29,266,000
流動負債合計	805,773,229	658,707,383
負債合計	805,773,229	658,707,383
純資産の部		
元本等		
元本 1	32,599,135,387	36,668,053,622
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	63,198,399,059	90,870,384,705
元本等合計	95,797,534,446	127,538,438,327
純資産合計	95,797,534,446	127,538,438,327
負債純資産合計	96,603,307,675	128,197,145,710

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11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	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	35,358,466,590円	32,599,135,387円
期中追加設定元本額	37,389,612,621円	5,787,582,584円
期中一部解約元本額	40,148,943,824円	1,718,664,349円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド （FOFs用）（適格機関投資家 専用）	29,826,184,382円	33,868,187,627円
安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	12,713,653円	9,351,880円
インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	10,771,748円	8,888,987円

	成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	55,980,030円	43,937,390円
	6資産バランスファンド(分配型)	110,059,334円	85,144,047円
	6資産バランスファンド(成長型)	260,481,037円	226,955,404円
	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	33,452,934円	23,688,636円
	『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	1,277,759円	-円
	ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	34,477,349円	26,469,712円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	299,003,468円	315,250,826円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	365,816,395円	401,490,597円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	487,272,518円	588,220,067円
	DCダイワJ-REITアクティブファンド	334,817,219円	298,157,653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)	77,108,060円	62,345,842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)	26,418,611円	20,683,514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)	121,041,776円	98,365,944円
	ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	542,259,114円	590,915,496円
	計	32,599,135,387円	36,668,053,622円
2.	期末日における受益権の総数	32,599,135,387口	36,668,053,622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せん。	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せん。

投資証券 1,001,000,000円

投資証券 1,109,100,000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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11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	4,113,981,136	2,313,461,157
合計	4,113,981,136	2,313,461,157

（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（2020年11月11日から2021年1月12日まで、及び2021年11月11日から2022年1月11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	2021年1月12日 現在				2022年1月11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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000	2,401,800,000	-	2,397,000,000	4,800,000
合計	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000	2,401,800,000	-	2,397,000,000	4,800,000

（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）

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,9387円 (29,387円)	3,4782円 (34,782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	エスコンジャパンリート	4,340	624,526,000	
	サンケイリアルエステート	4,332	527,204,400	
	SOSILA物流リート投	1,687	282,572,500	
	東海道リート投資法	2,145	232,947,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,664	3,050,256,000	
	森ヒルズリート	24,556	3,737,423,200	
	産業ファンド	11,767	2,454,596,200	
	アドバンス・レジデンス	7,621	2,819,770,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	18,078	3,866,884,200	
	A P I 投資法人	8,144	3,375,688,000	
	G L P 投資法人	40,120	7,506,452,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	8,517	2,776,542,000	
	日本プロロジスリート	15,814	5,946,064,000	
	ONEリート投資法人	1,743	529,000,500	
	イオンリート投資	11,160	1,785,600,000	
	ヒューリックリート投資法	11,520	1,968,768,000	
	日本リート投資法人	3,839	1,514,485,500	
	積水ハウス・リート投資	34,988	2,931,994,400	
	トーセイ・リート投資法人	3,726	487,733,400	
	ケネディクス商業リート	7,597	2,124,880,900	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,428	224,910,000	
	野村不動産マスターF	43,906	7,024,960,000	
	ラサールロジポート投資	19,739	3,799,757,500	
	三井不ロジパーク	4,024	2,506,952,000	
三菱地所物流REIT	7,509	3,799,554,000		
ザイマックス・リート	3,691	433,692,500		

日本ビルファンド	14,275	9,464,325,000	
ジャパンリアルエステイト	10,510	6,778,950,000	
日本都市ファンド投資法人	65,777	6,413,257,500	
オリックス不動産投資	20,960	3,640,752,000	
日本プライムリアルティ	5,661	2,170,993,500	
NTT都市開発リート投資法人	4,349	668,006,400	
東急リアル・エステート	2,035	398,249,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	5,605	655,785,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	30,040	4,109,472,000	
森トラスト総合リート	3,833	545,052,600	
インヴィンシブル投資法人	54,495	1,967,269,500	
フロンティア不動産投資	3,552	1,736,928,000	
平和不動産リート	1,533	229,643,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,713	1,962,415,500	
福岡リート投資法人	7,570	1,261,162,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,890	3,442,560,000	
いちごオフィスリート投資法人	15,878	1,300,408,200	
大和証券オフィス投資法人	2,210	1,553,630,000	
スタートプロシード投資法人	756	173,728,800	
大和ハウスリート投資法人	16,787	5,833,482,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	36,494	2,010,819,400	
ジャパンエクセレント投資法人	12,159	1,634,169,600	
投資証券 合計		124,284,274,600	
合計		124,284,274,600	

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。

日本ビルファンド 700口 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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	44,929,876	119,165,866
コール・ローン	22,731,207	107,651,650
株式	2,645,193,418	3,305,389,954
ハイブリッド優先証券	471,463,756	699,149,936
投資証券	23,931,896	21,818,440
未収入金	-	38,024,577
未収配当金	2,588,753	3,137,088
未収利息	559,222	1,149,546
流動資産合計	3,211,398,128	4,295,487,057
資産合計	3,211,398,128	4,295,487,057
負債の部		
流動負債		
未払金	2,343,468	45,718,442
未払解約金	518,000	6,188,000
流動負債合計	2,861,468	51,906,442
負債合計	2,861,468	51,906,442
純資産の部		
元本等		
元本	1 946,303,989	941,474,515
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,262,232,671	3,302,106,100
元本等合計	3,208,536,660	4,243,580,615
純資産合計	3,208,536,660	4,243,580,615
負債純資産合計	3,211,398,128	4,295,487,057

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

### (2)ハイブリッド優先証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

### (3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### 為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	922,190,111円	946,303,989円
期中追加設定元本額	121,921,838円	83,286,473円
期中一部解約元本額	97,807,960円	88,115,947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）	7,140,495円	4,818,265円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,125,953円	4,572,820円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	116,510,790円	80,684,731円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	19,740,852円	12,471,342円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	20,323,891円	13,707,913円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	132,401,213円	129,184,441円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	242,195,048円	246,321,189円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	401,865,747円	449,713,814円
計	946,303,989円	941,474,515円
2. 期末日における受益権の総数	946,303,989口	941,474,515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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11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	241,947,263	166,965,893
ハイブリッド優先証券	5,025,048	15,946,186
投資証券	132,093	81,429
合計	237,054,308	150,938,278

（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（2020年10月16日から2021年1月12日まで、及び2021年10月16日から2022年1月11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

2021年1月12日現在	2022年1月11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）

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額	3.3906円	4.5074円
（1万口当たり純資産額）	（33,906円）	（45,074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	1,034	135.260	139,858.840	
	ADOBE INC	1,608	525.830	845,534.640	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,272	295.100	375,367.200	
	ALBEMARLE CORP	1,217	226.970	276,222.490	
ATMOS ENERGY CORP	2,219	105.150	233,327.850		

CITIGROUP INC	6,570	66.030	433,817.100
DANAHER CORP	929	303.030	281,514.870
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,434	131.500	451,571.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,485	69.930	453,496.050
TE CONNECTIVITY LTD	2,151	158.270	340,438.770
APPLE INC	10,250	172.190	1,764,947.500
BOEING CO/THE	1,263	209.310	264,358.530
NISOURCE INC	8,383	27.770	232,795.910
VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,153	53.870	654,682.110
JPMORGAN CHASE & CO	4,739	167.320	792,929.480
CATERPILLAR INC	1,378	221.640	305,419.920
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,385	51.710	433,588.350
MORGAN STANLEY	3,461	104.130	360,393.930
BROADCOM INC	1,501	621.160	932,361.160
DEERE & CO	1,059	379.860	402,271.740
TELEFLEX INC	528	323.520	170,818.560
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,722	83.710	144,148.620
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,947	63.110	185,985.170
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,114	291.620	324,864.680
AMAZON.COM INC	259	3,229.720	836,497.480
FORD MOTOR CO	10,011	23.850	238,762.350
GENERAL ELECTRIC CO	1,325	99.420	131,731.500
GENERAL MOTORS CO	3,878	61.070	236,829.460
GOLDMAN SACHS GROUP INC	920	399.170	367,236.400
ALPHABET INC-CL A	131	2,773.390	363,314.090
HOME DEPOT INC	817	387.460	316,554.820
JOHNSON & JOHNSON	2,977	173.090	515,288.930
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	12,962	44.720	579,660.640
MCDONALD'S CORP	1,355	264.410	358,275.550
META PLATFORMS INC CLASS A	2,902	328.070	952,059.140
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,201	256.030	563,522.030
MERCK & CO. INC.	2,092	82.370	172,318.040
NIKE INC -CL B	1,197	150.440	180,076.680
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,990	287.970	573,060.300
NORTHROP GRUMMAN CORP	790	402.230	317,761.700
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,146	100.280	315,480.880
PFIZER INC	3,523	56.240	198,133.520

DOW INC	9,163	58.400	535,119.200	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,593	160.520	255,708.360	
TESLA INC	302	1,058.120	319,552.240	
ORGANON & CO	209	32.210	6,731.890	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,275	211.730	481,685.750	
ANTHEM INC	421	437.830	184,326.430	
WALT DISNEY CO/THE	1,801	156.600	282,036.600	
WASTE MANAGEMENT INC	2,425	159.410	386,569.250	
WALMART INC	852	144.610	123,207.720	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	532	535.410	284,838.120	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,367	232.620	317,991.540	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,389	211.970	294,426.330	
NVIDIA CORP	1,850	274.000	506,900.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,288	222.450	286,515.600	
TYSON FOODS INC-CL A	1,671	90.770	151,676.670	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	455	625.040	284,393.200	
MASTERCARD INC - A	799	363.910	290,764.090	
BANK OF AMERICA CORP	13,181	48.930	644,946.330	
EATON CORP PLC	2,509	166.420	417,547.780	
ECOLAB INC	1,024	225.840	231,260.160	
INTEL CORP	3,089	55.210	170,543.690	
MICROSOFT CORP	5,501	314.270	1,728,799.270	
MEDTRONIC PLC	3,178	105.620	335,660.360	
MICRON TECHNOLOGY INC	12,133	93.890	1,139,167.370	
COMCAST CORP-CLASS A	4,220	50.520	213,194.400	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 27,890,840.330 (3,216,929,523)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
SUNCOR ENERGY INC	23,232	33.710	783,150.720	
ENBRIDGE INC	3,643	51.630	188,088.090	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 971,238.810 (88,460,431)	
合計			3,305,389,954 [3,305,389,954]	

## (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	130,890.750	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2,558.000	74,361.060	
		ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	30,276.000	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	633.000	18,034.170	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	4,465.000	112,473.350	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2,582.000	65,815.180	
		VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2,076.000	52,605.840	
		SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	50,809.510	
		ENBRIDGE INC 6.375 B	497.000	13,225.170	
		BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2,725.000	71,994.500	
		UNUM GROUP 6.25	4,012.000	104,994.040	
		KEYCORP 5.65 F	952.000	25,132.800	
		JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	2,235.000	59,920.350	
		ASSOC BANC-CORP 5.875 E	3,957.000	104,029.530	
		NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	76,066.700	
		JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2,328.000	63,205.200	
		CMS ENERGY CORP 5.875	4,546.000	122,105.560	
		REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,367.000	38,549.400	
		ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	3,209.000	86,290.010	
		SPIRE INC 5.9 A	3,556.000	95,656.400	
		ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100.000	31,647.000	
		SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	4,851.000	131,025.510	
		ALLSTATE CORP 5.1 H	6,144.000	163,061.760	
		SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	172,860.860	
		FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1,923.000	49,786.470	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6,414.000	167,148.840			
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	9,130.000	239,114.700			
SOUTHERN CO 4.95 2020	8,035.000	212,445.400			



WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	12,614.000	321,657.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	10,442.000	266,897.520	
FIRST HORIZON CORP 6.5	3,936.000	106,193.280	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	5,778.000	162,419.580	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	5,735.000	150,429.050	
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2,438.000	65,240.880	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167.000	78,731.620	
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	8,422.000	214,508.340	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	6,161.000	158,892.190	
US CELLULAR CORP 5.5	1,667.000	43,091.950	
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	7,682.000	188,823.560	
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	6,503.000	167,777.400	
SIGNATURE BANK NEW YORK 5 a	4,900.000	124,754.000	
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10,983.000	292,367.460	
TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	4,979.000	133,038.880	
TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	5,524.000	144,397.360	
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	4,799.000	122,134.550	
CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	1,345.000	34,458.900	
FIRST HORIZON CORP 4.7 F	4,185.000	105,671.250	
REGIONS FINANCIAL CORP 4.45 E	1,326.000	32,977.620	
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	7,515.000	191,557.350	
HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C	400.000	10,336.000	
ATHENE HOLDING LTD 4.875 D	5,141.000	130,838.450	
FIRST REPUBLIC BANK 4.5	2,100.000	53,046.000	
MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589.000	43,570.380	
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,290.000	33,243.300	

		MORGAN STANLEY 6.375 I	1,593.000	44,078.310	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	2,892.000	76,985.040	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 6,061,643.280 (699,149,936)	
ハイブリッド優先証券 合計				699,149,936 [699,149,936]	
投資証券	アメリカ・ドル	UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1,200	30,948.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	2,875	72,420.960	
		SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1,350	34,290.130	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIE 4.75	2,012	51,507.200	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 189,166.290 (21,818,440)	
投資証券 合計				21,818,440 [21,818,440]	
合計				720,968,376 [720,968,376]	

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 67銘柄	81.6%	17.8%	0.6%	97.8%
	ハイブリッド 優先証券 56銘柄				
	投資証券 4銘柄				
カナダ・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	-%	2.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	33,439,138	9,859,949
コール・ローン	13,703,260	4,208,292
株式	1,255,145,752	1,457,201,636
未収配当金	2,505,399	2,045,878
流動資産合計	1,304,793,549	1,473,315,755
資産合計	1,304,793,549	1,473,315,755
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,779,000	2,540,000
流動負債合計	2,779,000	2,540,000
負債合計	2,779,000	2,540,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 740,519,917	671,590,671
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	561,494,632	799,185,084
元本等合計	1,302,014,549	1,470,775,755
純資産合計	1,302,014,549	1,470,775,755
負債純資産合計	1,304,793,549	1,473,315,755

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
-----	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
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	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日

期首元本額	753,612,190円	740,519,917円
期中追加設定元本額	114,473,683円	53,140,381円
期中一部解約元本額	127,565,956円	122,069,627円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	14,138,671円	10,025,550円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	11,985,441円	9,425,055円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	222,883,258円	167,318,233円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	37,983,195円	25,991,297円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	39,060,634円	28,464,799円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	70,482,573円	67,165,600円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	129,181,575円	128,098,349円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	214,804,570円	235,101,788円
計	740,519,917円	671,590,671円
2. 期末日における受益権の総数	740,519,917口	671,590,671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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年1月12日現在	2022年1月11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	96,172,228	75,913,591
合計	96,172,228	75,913,591

（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（2020年10月16日から2021年1月12日まで、及び2021年10月16日から2022年1月11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

2021年1月12日現在	2022年1月11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）

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7582円 (17,582円)	2.1900円 (21,900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	
	UNILEVER PLC	4,489	39.665	178,056.180	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	12.960	192,378.240	
	AVIVA PLC	40,669	4.339	176,462.790	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	16.114	256,212.600	
	M&G PLC	68,765	2.073	142,549.840	
	TESCO PLC	88,445	2.924	258,657.400	
	VODAFONE GROUP PLC	101,657	1.174	119,406.310	
	NATIONAL GRID PLC	17,873	10.534	188,274.180	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	4.920	213,547.680	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	17.306	203,535.860		
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,929,081.080 (302,151,970)	
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	371.200	487,385.600	
	NESTLE SA-REG	5,578	121.900	679,958.200	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	903	423.400	382,330.200	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	82.390	361,609.710	
GIVAUDAN-REG	95	4,405.000	418,475.000		
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 2,329,758.710 (289,938,471)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,486	212.900	529,269.400	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 529,269.400 (6,705,842)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	

SIEMENS AG-REG	2,800	147.880	414,064.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	97.200	291,211.200	
BASF SE	3,676	66.090	242,946.840	
ALLIANZ SE-REG	1,145	223.400	255,793.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,037	272.350	282,426.950	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	15.528	328,339.560	
DEUTSCHE POST AG-REG	6,823	53.510	365,098.730	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	7,785	33.310	259,318.350	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	30.530	198,628.180	
KONINKLIJKE DSM NV	2,117	181.400	384,023.800	
KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.760	242,684.040	
TOTALENERGIES SE	6,299	46.740	294,415.260	
MICHELIN (CGDE)	2,155	152.500	328,637.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,895	160.700	465,226.500	
BNP PARIBAS	3,990	64.000	255,360.000	
CAPGEMINI SE	1,883	194.450	366,149.350	
AXA SA	12,126	27.405	332,313.030	
SANOFI	3,893	88.850	345,893.050	
INTESA SANPAOLO	100,555	2.463	247,666.960	
ENI SPA	12,935	12.684	164,067.540	
ENEL SPA	48,153	6.930	333,700.290	
ENAGAS SA	8,545	19.870	169,789.150	
ユーロ 小計			ユーロ 6,567,753.280 (858,405,353)	
合計			1,457,201,636 [1,457,201,636]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	20.7%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	19.9%



スウェーデン・クローナ	株式	1銘柄	100%	0.5%
ユーロ	株式	22銘柄	100%	58.9%

## 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

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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	22,424,990	21,998,692
コール・ローン	4,324,649	8,335,979
株式	698,888,104	668,759,575
派生商品評価勘定	15,604	-
未収入金	39,306,245	-
未収配当金	712,842	235,509
流動資産合計	765,672,434	699,329,755
資産合計	765,672,434	699,329,755
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,820	-
未払解約金	3,014,000	5,812,000
流動負債合計	3,037,820	5,812,000
負債合計	3,037,820	5,812,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 281,837,347	233,981,686
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	480,797,267	459,536,069
元本等合計	762,634,614	693,517,755
純資産合計	762,634,614	693,517,755

負債純資産合計	765,672,434	699,329,755
---------	-------------	-------------

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	365,560,068円	281,837,347円
期中追加設定元本額	13,237,838円	18,095,870円
期中一部解約元本額	96,960,559円	65,951,531円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	9,692,362円	7,542,994円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,198,991円	7,116,298円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	157,435,181円	124,105,017円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	26,377,648円	19,317,654円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	26,668,165円	21,002,510円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	9,134,583円	8,505,757円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	16,756,169円	16,368,771円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	27,574,248円	30,022,685円
計	281,837,347円	233,981,686円
2. 期末日における受益権の総数	281,837,347口	233,981,686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 2021年1月13日 至 2022年1月11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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11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	121,599,871	36,310,917
合計	121,599,871	36,310,917

(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(2020年10月16日から2021年1月12日まで、及び2021年10月16日から2022年1月11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	2021年1月12日 現在				2022年1月11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	14,793,604	-	14,784,000	9,604	-	-	-	-
香港・ドル	14,793,604	-	14,784,000	9,604	-	-	-	-
買 建	10,679,820	-	10,662,000	17,820	-	-	-	-
韓国・ウォン	2,844,000	-	2,850,000	6,000	-	-	-	-
台湾・ドル	7,835,820	-	7,812,000	23,820	-	-	-	-
合計	25,473,424	-	25,446,000	8,216	-	-	-	-

(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)

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7059円 (27,059円)	2.9640円 (29,640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	6,300	44.780	282,114.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	3,400	23.230	78,982.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	13,900	29.390	408,521.000	
	WESTPAC BANKING CORP	9,600	21.830	209,568.000	
	SANTOS LTD	11,734	6.840	80,260.560	
	RIO TINTO LTD	700	105.990	74,193.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,150	103.320	428,778.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,000	207.980	207,980.000	
	CSL LTD	400	280.000	112,000.000	
WESFARMERS LTD	4,200	57.120	239,904.000		
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,122,300.560 (176,002,385)	
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	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	23,900	3.560	85,084.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,800	35.070	203,406.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	4.300	73,100.000		
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル	

				361,590.000	
				(30,778,541)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA CORP	700	83,800.000	58,660,000.000	
	SK HYNIX INC	1,800	124,500.000	224,100,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	500	209,500.000	104,750,000.000	
	POSCO	330	304,000.000	100,320,000.000	
	HYUNDAI MOBIS CO LTD	230	262,000.000	60,260,000.000	
	E-MART INC	400	149,000.000	59,600,000.000	
	NAVER CORP	390	335,000.000	130,650,000.000	
	LG CHEM LTD	90	710,000.000	63,900,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	3,200	57,800.000	184,960,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,600	78,000.000	514,800,000.000	
	SK TELECOM	607	56,500.000	34,295,500.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	3,400	45,400.000	154,360,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,690,655,500.000 (163,317,321)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,000	95.000	570,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,200	458.200	1,008,040.000	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	23,000	7.600	174,800.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	143,000	5.750	822,250.000	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	62,200	5.400	335,880.000	
	AIA GROUP LTD	20,200	80.000	1,616,000.000	
	SANDS CHINA LTD	20,800	17.260	359,008.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	5,500	139.000	764,500.000	
	WEICHAO POWER CO LTD-H	12,000	15.720	188,640.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	9.100	163,800.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	13,500	62.700	846,450.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 6,849,368.000 (101,302,153)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	402.500	1,207,500.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	977.000	1,954,000.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	3,000	283.500	850,500.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	74.900	749,000.000	
	MEDIATEK INC	6,000	1,095.000	6,570,000.000	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	85,000	36.150	3,072,750.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	128,000	26.400	3,379,200.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3,000	510.000	1,530,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	354.500	1,418,000.000	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	325.000	3,575,000.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	24,000	643.000	15,432,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	21,000	104.500	2,194,500.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	87,000	62.100	5,402,700.000	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 47,335,150.000 (197,359,175)	
合計			668,759,575 [668,759,575]	

## (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
オーストラリア・ドル	株式 10銘柄	100%	26.3%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	4.6%
韓国・ウォン	株式 12銘柄	100%	24.4%
香港・ドル	株式 11銘柄	100%	15.1%
台湾・ドル	株式 13銘柄	100%	29.6%

## 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

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,345,078	753,646,477
株式	15,882,391,960	15,474,691,330
未収入金	-	13,255,239
未収配当金	27,877,750	27,801,500
流動資産合計	16,130,614,788	16,269,394,546
資産合計	16,130,614,788	16,269,394,546
負債の部		
流動負債		
未払金	19,722,053	92,739,590
未払解約金	9,815,000	28,201,000
流動負債合計	29,537,053	120,940,590
負債合計	29,537,053	120,940,590
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,432,945,076	4,588,117,450
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,668,132,659	11,560,336,506
元本等合計	16,101,077,735	16,148,453,956
純資産合計	16,101,077,735	16,148,453,956
負債純資産合計	16,130,614,788	16,269,394,546

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
-----	------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	6,085,455,292円	5,432,945,076円
期中追加設定元本額	340,283,342円	378,056,423円
期中一部解約元本額	992,793,558円	1,222,884,049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)	3,615,424,047円	2,729,191,047円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	25,061,574円	23,356,273円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	25,444,630円	19,555,722円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	22,276,776円	18,175,845円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	408,556,095円	316,475,131円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	68,236,074円	49,514,385円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	70,435,625円	53,853,011円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	203,970,079円	214,965,887円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）	373,184,938円	410,404,198円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	620,355,238円	752,625,951円
計	5,432,945,076円	4,588,117,450円
2. 期末日における受益権の総数	5,432,945,076口	4,588,117,450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 2021年1月13日 至 2022年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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	2022年1月11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	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	2,117,078,397	404,139,256
合計	2,117,078,397	404,139,256

（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（2020年10月16日から2021年1月12日まで、及び2021年10月16日から2022年1月11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

2021年1月12日現在	2022年1月11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）

	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.9636円	3.5196円
（1万口当たり純資産額）	（29,636円）	（35,196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	
オリエンタル白石	294,400	235.00	69,184,000	
住友林業	79,500	2,185.00	173,707,500	
大和ハウス	34,400	3,345.00	115,068,000	
九電工	29,300	3,460.00	101,378,000	
ブルボン	22,400	2,454.00	54,969,600	
ディップ	26,500	3,695.00	97,917,500	
アサヒグループホールディング	23,700	4,587.00	108,711,900	
エレマテック	21,700	1,082.00	23,479,400	
パルグループHLDGS	67,300	1,601.00	107,747,300	
太陽化学	22,300	1,710.00	38,133,000	
日本たばこ産業	34,400	2,365.50	81,373,200	
アルコニックス	29,600	1,373.00	40,640,800	
富士紡ホールディングス	16,100	4,090.00	65,849,000	

ダイワボウHD	60,100	1,768.00	106,256,800
トヨタ紡織	57,600	2,401.00	138,297,600
レスターホールディングス	11,100	1,941.00	21,545,100
TOKAIホールディングス	184,600	873.00	161,155,800
三洋貿易	84,000	1,000.00	84,000,000
帝国繊維	15,100	2,101.00	31,725,100
旭化成	260,200	1,123.00	292,204,600
AND DOホールディングス	46,800	870.00	40,716,000
コメダホールディングス	31,600	2,040.00	64,464,000
共和レザー	64,400	661.00	42,568,400
セーレン	40,600	2,555.00	103,733,000
ワコールホールディングス	51,300	2,103.00	107,883,900
SRAホールディングス	7,500	2,814.00	21,105,000
昭和電工	27,800	2,582.00	71,779,600
日本曹達	30,900	3,305.00	102,124,500
大阪ソーダ	21,200	3,005.00	63,706,000
信越化学	8,800	19,385.00	170,588,000
エア・ウォーター	54,600	1,795.00	98,007,000
四国化成	45,200	1,392.00	62,918,400
東京応化工業	10,900	6,430.00	70,087,000
住友ベークライト	22,800	5,850.00	133,380,000
旭有機材	23,100	1,737.00	40,124,700
第一工業製薬	45,300	3,175.00	143,827,500
日本空調サービス	74,600	799.00	59,605,400
伊藤忠テクノソリューションズ	29,200	3,455.00	100,886,000
フルキャストホールディングス	38,700	2,082.00	80,573,400
富士フイルムHDGS	43,200	8,494.00	366,940,800
デクセリアルズ	100,000	3,695.00	369,500,000
AGC	77,200	5,300.00	409,160,000
ニチアス	50,700	2,762.00	140,033,400
日本製鉄	35,600	2,048.50	72,926,600
三菱製鋼	30,100	1,068.00	32,146,800
三井金属	37,300	3,190.00	118,987,000
三和ホールディングス	69,200	1,247.00	86,292,400
日東精工	77,400	613.00	47,446,200
マルゼン	30,900	2,200.00	67,980,000
ファインシンター	18,900	1,630.00	30,807,000
ツガミ	95,500	1,656.00	158,148,000
ソディック	84,400	806.00	68,026,400
ベルシステム24HDGS	72,100	1,203.00	86,736,300

豊田自動織機	19,000	9,400.00	178,600,000
フリー	45,400	1,261.00	57,249,400
三精テクノロジーズ	28,500	751.00	21,403,500
キトー	56,600	1,917.00	108,502,200
日立	88,500	6,784.00	600,384,000
富士電機	57,100	6,200.00	354,020,000
I D E C	35,500	2,626.00	93,223,000
T D K	33,900	4,405.00	149,329,500
デンソー	29,800	10,060.00	299,788,000
村田製作所	17,700	9,028.00	159,795,600
I H I	68,400	2,452.00	167,716,800
プレミアグループ	60,400	3,565.00	215,326,000
いすゞ自動車	110,500	1,465.00	161,882,500
トヨタ自動車	243,500	2,322.00	565,407,000
プレス工業	116,000	411.00	47,676,000
ミクニ	67,400	395.00	26,623,000
萩原電気H L D G S	17,300	1,999.00	34,582,700
アルゴグラフィックス	31,100	3,245.00	100,919,500
ダイトロン	42,500	2,098.00	89,165,000
スター精密	52,500	1,546.00	81,165,000
フジシールインターナショナル	49,400	2,225.00	109,915,000
大日本印刷	119,900	2,874.00	344,592,600
藤森工業	10,000	4,085.00	40,850,000
リンテック	22,400	2,694.00	60,345,600
信越ポリマー	123,700	1,086.00	134,338,200
伊藤忠	99,300	3,528.00	350,330,400
東京エレクトロン	6,600	62,750.00	414,150,000
スターゼン	20,800	1,999.00	41,579,200
セイコーHD	38,900	2,186.00	85,035,400
日本ユニシス	48,900	3,080.00	150,612,000
三菱商事	101,700	3,772.00	383,612,400
稲畑産業	40,800	1,676.00	68,380,800
しまむら	34,300	9,630.00	330,309,000
丸井グループ	69,900	2,222.00	155,317,800
三菱UFJフィナンシャルG	609,200	701.40	427,292,880
三井住友フィナンシャルG	95,400	4,255.00	405,927,000
S B Iホールディングス	35,600	3,145.00	111,962,000
オリックス	181,800	2,465.50	448,227,900
M S & A D	52,200	3,898.00	203,475,600
第一生命H L D G S	78,900	2,671.50	210,781,350

東京海上H D	67,300	7,010.00	471,773,000	
東京建物	80,600	1,694.00	136,536,400	
山 九	33,300	4,725.00	157,342,500	
丸全昭和運輸	13,800	3,155.00	43,539,000	
三井倉庫H O L D	54,600	2,439.00	133,169,400	
日本電信電話	125,300	3,307.00	414,367,100	
K D D I	108,600	3,593.00	390,199,800	
シーイーシー	27,500	1,078.00	29,645,000	
日本管財	5,900	2,836.00	16,732,400	
日鉄物産	28,000	5,180.00	145,040,000	
合計			15,474,691,330	

## (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16期計算期間(2021年1月13日から2022年1月11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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	96,603,304	126,687,968
親投資信託受益証券	6,428,508,091	8,526,809,928
未収入金	575,000	10,341,000
流動資産合計	6,525,686,395	8,663,838,896
資産合計	6,525,686,395	8,663,838,896
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,017,259	12,100,252
未払受託者報酬	1,695,859	2,256,168
未払委託者報酬	33,918,272	45,124,336
その他未払費用	254,288	338,341
流動負債合計	40,885,678	59,819,097
負債合計	40,885,678	59,819,097
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,443,846,915	1 3,918,064,052
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,040,953,802	4,685,955,747
（分配準備積立金）	951,666,768	1,889,853,969
元本等合計	6,484,800,717	8,604,019,799
純資産合計	6,484,800,717	8,604,019,799
負債純資産合計	6,525,686,395	8,663,838,896

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	2020年1月11日 至 2021年1月12日	自	2021年1月13日 至 2022年1月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		311		21
有価証券売買等損益		95,491,524		1,209,920,837
営業収益合計		95,491,835		1,209,920,858
<b>営業費用</b>				
支払利息		26,904		23,995
受託者報酬		3,184,549		4,203,307
委託者報酬		63,692,775		84,067,824
その他費用		478,137		630,370
営業費用合計		67,382,365		88,925,496
営業利益		28,109,470		1,120,995,362
経常利益		28,109,470		1,120,995,362
当期純利益		28,109,470		1,120,995,362
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（ ）		73,034,928		76,305,044
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,721,446,375		3,040,953,802
剰余金増加額又は欠損金減少額		754,703,067		989,062,102
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		754,703,067		989,062,102
剰余金減少額又は欠損金増加額		536,340,038		388,750,475
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		536,340,038		388,750,475
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,040,953,802		4,685,955,747

## (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16期	
	自 2021年1月13日	至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年1月12日としており、2022年1月10日が休日のため、当計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首元本額	3,061,995,528円	3,443,846,915円
期中追加設定元本額	998,812,762円	906,065,649円
期中一部解約元本額	616,961,375円	431,848,512円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,443,846,915口	3,918,064,052口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日	自 2021年1月13日 至 2022年1月11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	9,376,726円	12,523,115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(101,146,091円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,497,179,344円)及び分配準備積立金(850,520,677円)より分配可能額は3,448,846,112円(1万口当たり10,014.52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(1,044,691,555円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,078,586,002円)及び分配準備積立金(845,162,414円)より分配可能額は4,968,439,971円(1万口当たり12,680.85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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
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	<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	金融商品の時価の算定においては、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16期 2022年1月11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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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	109,230,552	1,165,088,609
合計	109,230,552	1,165,088,609

## (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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8830円 (18,830円)	2.1960円 (21,960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	448,579,124	1,404,097,516	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド（BPI）	1,094,214,275	1,404,971,129	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	383,107,917	1,437,497,526	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	410,404,198	1,444,458,615	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	246,321,189	1,110,268,127	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	128,098,349	280,535,384	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	16,368,771	48,517,037	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	401,490,597	1,396,464,594	
親投資信託受益証券 合計			8,526,809,928	
合計			8,526,809,928	

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16期計算期間(2021年1月13日から2022年1月11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/成長コース)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	109,605,453	165,287,633
親投資信託受益証券	7,175,520,706	10,450,112,147
未収入金	11,120,000	12,688,000
流動資産合計	7,296,246,159	10,628,087,780
資産合計	7,296,246,159	10,628,087,780
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,385,268	17,385,252
未払受託者報酬	1,831,327	2,729,359
未払委託者報酬	42,121,458	62,776,129
その他未払費用	274,613	409,320
流動負債合計	58,612,666	83,300,060
負債合計	58,612,666	83,300,060
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,580,161,955	1 4,264,260,205
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,657,471,538	6,280,527,515
(分配準備積立金)	1,208,632,750	2,702,131,901
元本等合計	7,237,633,493	10,544,787,720
純資産合計	7,237,633,493	10,544,787,720
負債純資産合計	7,296,246,159	10,628,087,780

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12日	第16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
<b>営業収益</b>		
受取利息	342	27
有価証券売買等損益	121,247,407	1,839,070,441
<b>営業収益合計</b>	<b>121,247,749</b>	<b>1,839,070,468</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	29,619	29,312
受託者報酬	3,402,323	4,980,252
委託者報酬	178,255,738	114,547,848
その他費用	510,883	746,925
<b>営業費用合計</b>	<b>82,198,563</b>	<b>120,304,337</b>
<b>営業利益</b>	<b>39,049,186</b>	<b>1,718,766,131</b>
経常利益	39,049,186	1,718,766,131
<b>当期純利益</b>	<b>39,049,186</b>	<b>1,718,766,131</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( )	107,754,907	103,914,899
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,223,357,246	3,657,471,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	876,016,089	1,441,476,246
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	876,016,089	1,441,476,246
剰余金減少額又は欠損金増加額	588,705,890	433,271,501
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	588,705,890	433,271,501
分配金	2 -	2 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>3,657,471,538</b>	<b>6,280,527,515</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16期	
	自 2021年1月13日	至 2022年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年1月12日としており、2022年1月10日が休日のため、当計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	2021年1月12日現在	2022年1月11日現在
1. 1 期首元本額	3,104,040,281円	3,580,161,955円
期中追加設定元本額	1,060,242,411円	1,096,214,144円
期中一部解約元本額	584,120,737円	412,115,894円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,580,161,955口	4,264,260,205口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日	自 2021年1月13日 至 2022年1月11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	13,605,054円	19,869,319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(146,809,745円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,150,285,577円)及び分配準備積立金(1,061,823,005円)より分配可能額は4,358,918,327円(1万口当たり12,175.20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(1,614,854,868円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,104,543,539円)及び分配準備積立金(1,087,277,033円)より分配可能額は6,806,675,440円(1万口当たり15,962.15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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11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16期 2022年1月11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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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	140,670,148	1,794,888,396
合計	140,670,148	1,794,888,396

## (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15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11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16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	第15期 2021年1月12日現在	第16期 2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0216円 (20,216円)	2,4728円 (24,728円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	外国債券インデックスマザーファンド	164,219,760	514,024,270	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	400,305,943	513,992,830	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	558,687,041	2,096,305,515	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	752,625,951	2,648,942,297	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	449,713,814	2,027,040,045	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	235,101,788	514,872,915	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	30,022,685	88,987,238	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	588,220,067	2,045,947,037	
親投資信託受益証券 合計			10,450,112,147	
合計			10,450,112,147	

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/安定コース)

## 【純資産額計算書】

2022年1月31日

資産総額	7,358,103,005円
負債総額	17,958,924円
純資産総額( - )	7,340,144,081円
発行済数量	3,759,099,411口
1単位当たり純資産額( / )	1.9526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

2022年1月31日

資産総額	234,247,254,805円
負債総額	662,453,525円
純資産総額( - )	233,584,801,280円
発行済数量	75,295,032,585口
1単位当たり純資産額( / )	3.1023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

2022年1月31日

資産総額	37,582,659,905円
負債総額	16,862,000円
純資産総額( - )	37,565,797,905円
発行済数量	29,341,043,723口
1単位当たり純資産額( / )	1.2803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

2022年1月31日

資産総額	101,464,355,479円
負債総額	926,285,293円
純資産総額( - )	100,538,070,186円
発行済数量	28,060,755,482口
1単位当たり純資産額( / )	3.5829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

2022年1月31日

資産総額	125,907,183,218円
負債総額	1,157,576,475円
純資産総額( - )	124,749,606,743円
発行済数量	36,972,886,634口
1単位当たり純資産額( / )	3.3741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

2022年1月31日

資産総額	4,094,109,389円
負債総額	22,885,982円
純資産総額( - )	4,071,223,407円
発行済数量	947,220,724口
1単位当たり純資産額( / )	4.2981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

2022年1月31日

資産総額	1,432,569,019円
負債総額	299,000円

純資産総額( - )	1,432,270,019円
発行済数量	665,937,833口
1単位当たり純資産額( / )	2.1508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

2022年1月31日

資産総額	663,276,354円
負債総額	945,000円
純資産総額( - )	662,331,354円
発行済数量	232,648,082口
1単位当たり純資産額( / )	2.8469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

2022年1月31日

資産総額	15,398,778,279円
負債総額	58,175,504円
純資産総額( - )	15,340,602,775円
発行済数量	4,538,074,969口
1単位当たり純資産額( / )	3.3804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

2022年1月31日

資産総額	8,415,755,481円
負債総額	17,930,095円
純資産総額( - )	8,397,825,386円
発行済数量	3,934,709,512口
1単位当たり純資産額( / )	2.1343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

2022年1月31日

資産総額	10,274,842,064円
負債総額	28,355,334円
純資産総額( - )	10,246,486,730円
発行済数量	4,297,876,976口
1単位当たり純資産額( / )	2.3841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。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2022年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### 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、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. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

##### ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. 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。

## 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。

2022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	65	192,036
追加型株式投資信託	781	20,567,313
株式投資信託 合計	846	20,759,349
単位型公社債投資信託	78	213,110
追加型公社債投資信託	14	1,441,583
公社債投資信託 合計	92	1,654,693
総合計	938	22,414,042

## 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。

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改政府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則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62期事業年度（2020年4月1日から2021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63期事業年度に係る中間会計期間（2021年4月1日から2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539

固定資産				
有形固定資産	1	217	1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068
繰延税金資産		1,431		973
その他		33		30
固定資産計		18,424		18,283
資産合計		54,512		55,822

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2	2
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
固定負債		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3

固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51

諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37
租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31 日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860

税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	78	109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,175	1,175	1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	363	363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

## 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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

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・参与及び上席参事についても、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。

## 6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「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 2018年2



月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(追加情報)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2018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 2018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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

(注記に関する表示方法の変更)

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」(企業会計基準第31号 2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という)が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、(重要な会計上の見積り)を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第6項及び第7項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金	3,397百万円	3,473百万円

3 保証債務

前事業年度(2020年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万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 2019年4月1日 至 2020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
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

## (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

2020年6月23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	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月24日

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020年 6月24日

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

2021年6月22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	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日

効力発生日

2021年6月23日

## （金融商品関係）

### 1．金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

##### 市場リスクの管理

##### （ ）為替変動リスクの管理

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

##### （ ）価格変動リスクの管理

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

##### 信用リスクの管理

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

### 2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表	計上額	時価	差額
投資有価証券(1)		60	60	-
資産合計		60	60	-

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表さ

れている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。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。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

(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(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,677百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

### 2. その他有価証券

前事業年度(2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、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(2021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	85	55	30

(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、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 2019年4月1日 至 2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

## (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

## 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181百万円、当事業年度186百万円であります。

## (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 of 主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750



賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	71	453
繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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(2020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(2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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親会社

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 -	18,700 -

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

###### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

## 前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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)	1,603	-	-

## 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 2020年4月1日 至 2021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)	1,727	-	-

## 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。

## (ウ) 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 2019年4月1日 至 2020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)	16,953	未払手数料	2,984
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)	1,031	未払費用	224
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)	1,061	長期差入保証金	1,054

## 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	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)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)  不動産の賃借料(注4)	14,917  527	未払手数料  長期差入保証金	3,321  1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

#### 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。

(注5)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

## 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
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 (2021年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,139
有価証券		250
未収委託者報酬		13,857
関係会社短期貸付金		16,300
その他		369
流動資産合計		32,916
固定資産		

有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2021年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	2	927

流動負債合計		13,635
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2

固定負債合計		2,571
--------	--	-------

## 負債合計

負債合計		16,206
------	--	--------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

## (2)中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	1	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	2	228
営業外費用	3	87
経常利益		9,540
特別利益		-
特別損失	4	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	9,388	9,388	9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
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	-	-	-	2,980	2,980	2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	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	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

## 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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

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・参与及び上席参事についても、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．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

#### 5. 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。

#### 6. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### 7. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「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 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

#### (会計方針の変更)

##### (収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

#### (中間貸借対照表関係)

##### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

##### 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(2021年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万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 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021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
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85			85
資産合計	85			85

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。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。

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021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 1,677百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、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	85	55	30
（2）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
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	3,179	3,398	219
小計	3,179	3,398	219
合計	10,956	9,294	1,661

（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、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、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%を超えており、かつ、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、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	13,724.67円

1株当たり中間純利益

2,456.52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 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
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

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

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

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



## 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】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	(注3)	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	株式会社りそな銀行	279,928百万円	(注6)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912千円 (2020年12月31日現在)		
	コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	535千米ドル (2020年12月31日現在)		

(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います。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 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。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

## 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。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

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。

## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2021年4月5日	有価証券報告書、有価証券届出書
2021年10月5日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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**監査意見**

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アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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。

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、大和アセットマネジメント株式会社の2021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、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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**

2022年2月18日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員**監査意見**

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2021年1月13日から2022年1月11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。

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2022年1月11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、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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**

2022年2月18日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

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2021年1月13日から2022年1月11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。

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2022年1月11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、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2022年2月18日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2021年1月13日から2022年1月11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。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2022年1月11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、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2021年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**中間監査意見**

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アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021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。

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、大和アセットマネジメント株式会社の2021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（2021年4月1日から2021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。

**中間監査意見の根拠**

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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、監査人は、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。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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。