【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年7月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）（愛称：四国の未来(年2回)）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または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/

(5)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社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。

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2023年7月4日から2023年12月28日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

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/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、わが国の株式および海外の債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式				
一般	年1回	グローバル（含む日本）		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
債券				
一般	年4回	北米	ファミリーファンド	あり（　　）
公債				
社債	年6回（隔月）	欧州		
その他債券				
クレジット属性（　　）	年12回（毎月）	アジア		
不動産投信				
その他資産		オセアニア		
（投資信託証券、資産複合、資産配分固定型、（株式、債券））	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
資産複合（　　）		アフリカ		
資産配分固定型	その他（　）	中近東（中東）		
資産配分変更型		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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
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

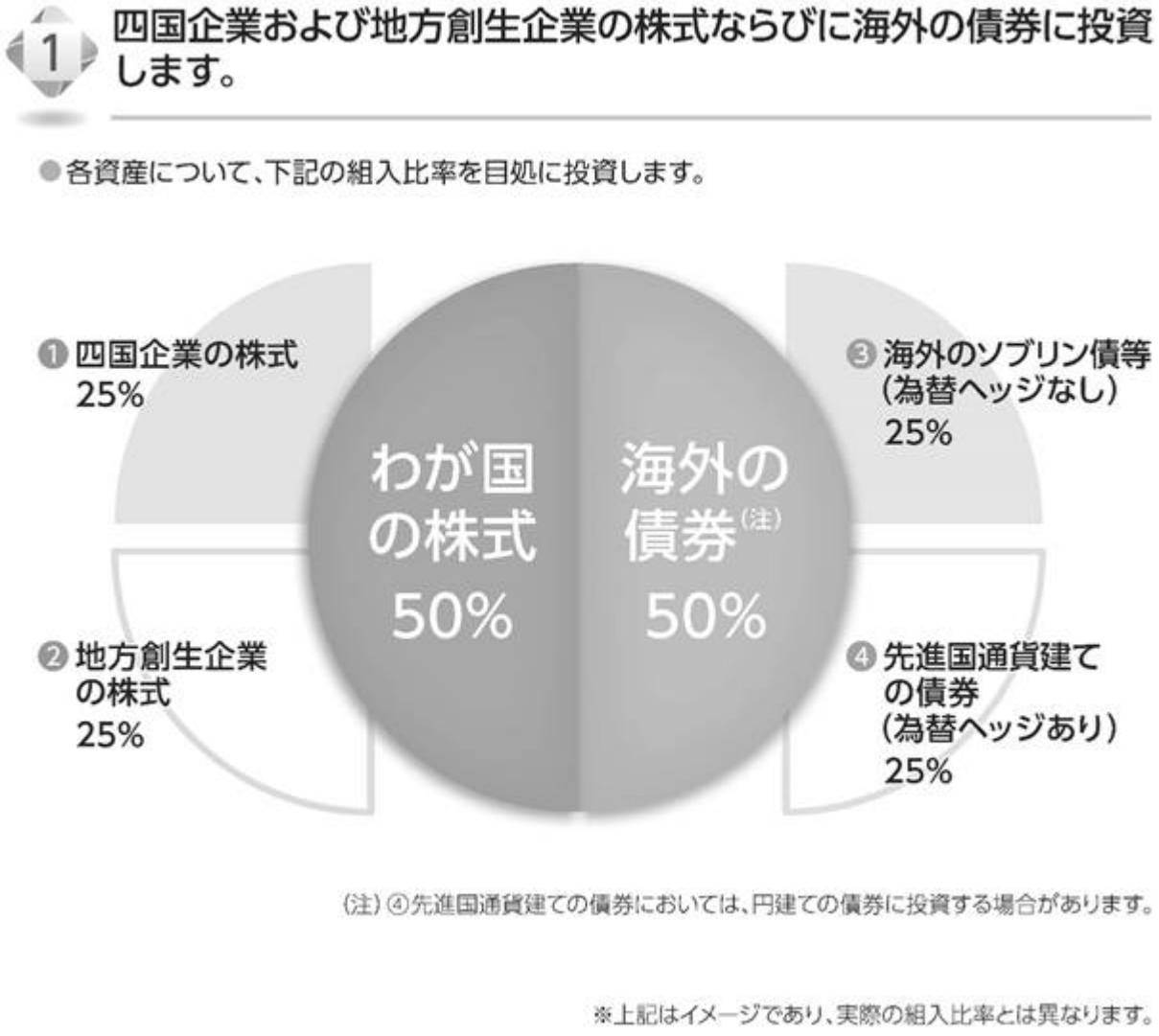
※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレスhttp://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、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。

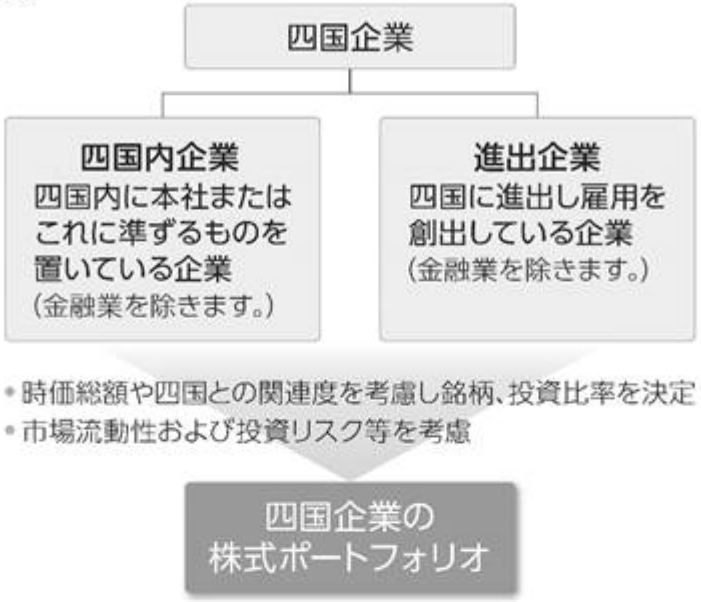
＜ファンドの特色＞



［各資産の投資方針］

❶四国企業の株式

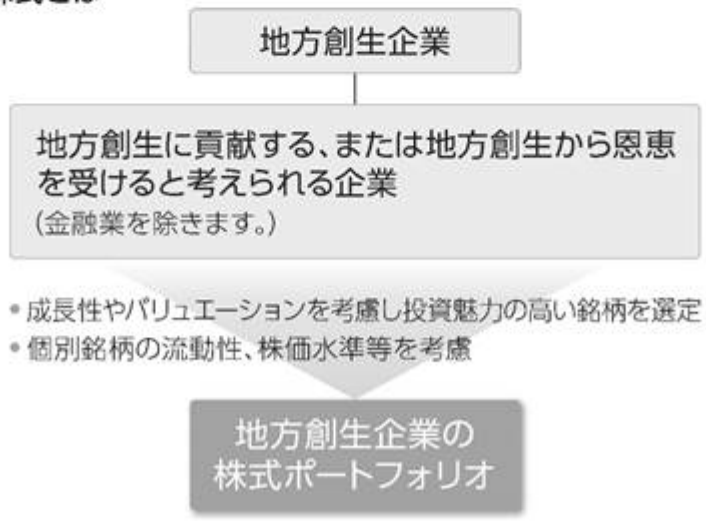
四国企業の株式とは



※「四国企業の株式」部分の運用は四国応援マザーファンドを通じて行ないます。当部分の運用について、くわしくは、「投資対象ファンドの概要　四国応援マザーファンド」をご参照下さい。

❷地方創生企業の株式

地方創生企業の株式とは



※「地方創生企業の株式」部分の運用は地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）を通じて行ないます。当部分の運用について、くわしくは、「投資対象ファンドの概要　地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）」をご参照下さい。

③ 海外のソブリン債等（為替ヘッジなし）

「海外のソブリン債等（為替ヘッジなし）」部分の運用にあたっては、海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）に投資します。

- ドル通貨圏、欧州通貨圏の2通貨圏への投資割合を50%程度ずつとすることを基本とします。（ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。）
- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでA3以上またはS&PでA−以上）、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上（ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上）とすることを基本とします。
- ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。
- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

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。

※「海外のソブリン債等（為替ヘッジなし）」部分の運用はダイワ・外債ソブリン・マザーファンドを通じて行ないます。当部分の運用について、くわしくは、「投資対象ファンドの概要　ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」をご参照下さい。

④ 先進国通貨建ての債券（為替ヘッジあり）

「先進国通貨建ての債券（為替ヘッジあり）」部分の運用にあたっては、先進国通貨建て債券に投資します。

- 先進国通貨とはFTSE世界国債インデックスの構成通貨をいいます。
- 組入れる債券（国債を除きます。）の格付けは、取得時においてBBB格相当以上（R&I、JCR、S&P、フィッチのいずれかでBBB−以上またはムーディーズでBaa3以上）とします。
- 運用の効率化を図るために、債券先物取引等を利用することがあります。

為替変動リスクを低減するための為替ヘッジを行ないます。

※「先進国通貨建ての債券（為替ヘッジあり）」部分の運用はネオ・ヘッジ付債券マザーファンドを通じて行ないます。当部分の運用について、くわしくは、「投資対象ファンドの概要　ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド」をご参照下さい。

FTSE世界国債インデックスについて

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。

［ご参考］

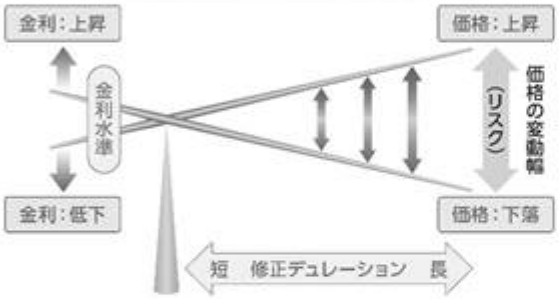
債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	R&I、JCR、S&P、フィッチの場合
高い	Aaa	AAA
投資適格	Aa（Aa1 / Aa2 / Aa3）	AA（AA+ / AA / AA−）
投資適格	A（A1 / A2 / A3）	A（A+ / A / A−）
投資適格	Baa（Baa1 / Baa2 / Baa3）	BBB（BBB+ / BBB / BBB−）
	Ba	BB
	B	B
低い	・	・

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ(Moody's)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研究所(JCR)、S&Pグローバル・レーティング(S&P)、フィッチ・レーティングス(Fitch)などといった格付会社が各債券の格付けを行なっています。
付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

修正デュレーションについて

金利変動と修正デュレーションの関係(イメージ)



- 修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。
- 修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動(ブレ幅)が大きくなります。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の４本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、四国企業の株式、地方創生企業の株式、海外のソブリン債等および先進国通貨建て債券に投資します。

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

- 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、ファンドの特色1.の運用が行なわれないことがあります。

毎年4月、10月の各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。

※第1計算期間は、2017年10月10日(休業日の場合翌営業日)までとします。

［分配方針］

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

❷ 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。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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。
- 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。

＜投資対象ファンドの概要＞

1. 四国応援マザーファンド

基本方針	**信託財産の成長をめざして運用を行ないます。**
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。）**

投資態度	1．　主として、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、四国企業（金融業を除きます。）に投資し、信託財産の成長をめざします。 2．　四国企業とは、四国内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（以下「四国内企業」といいます。）、および四国に進出し雇用を創出している企業(以下「進出企業」といいます。）とします。 3．　四国企業の株式への投資のうち個々の銘柄への投資については、市場流動性および投資リスク等を考慮します。 4．　四国内企業の株式への投資については、それぞれの時価総額に応じた投資比率（上限を設ける場合があります。5.においても同じ）とすることを基本とします。 5．　進出企業の株式への投資については、時価総額と四国内従業員数など四国との関連度を考慮して銘柄選定を行ない、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組入れを行なうことを基本とします。 6．　株式の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 7．　運用の効率化を図るため、わが国の株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数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。 8．　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。
信託期間	無期限（2017年7月28日当初設定）
決算日	毎年4月10日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

2．地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	地方創生マザーファンド（以下マザーファンドといいます。）の受益証券

投資態度	1．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、地方創生企業に投資し、信託財産の成長をめざします。 ※地方創生企業とは、地方創生に貢献する、または地方創生から恩恵を受けると考えられる企業（金融業を除きます。）とします。 2．マザーファンドの運用にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ)地方創生企業の株式を投資候補銘柄とします。 ロ)投資候補銘柄の中から、成長性やバリュエーションを考慮し、投資魅力の高い銘柄を選定します。 ハ)個別銘柄の流動性、株価水準等を考慮し、ポートフォリオを構築します。 ニ)投資候補銘柄およびポートフォリオの組入銘柄については、適宜見直しを行ないます。 3．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 4．マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、わが国の株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、株式の組入総額と株価指数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。 5．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。 6．当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみに取得させることを目的とするものです。
マザーファンドの投資態度	1．主として、わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）の中から、地方創生企業に投資し、信託財産の成長をめざします。 ※地方創生企業とは、地方創生に貢献する、または地方創生から恩恵を受けると考えられる企業（金融業を除きます。）とします。 2．ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ)地方創生企業の株式を投資候補銘柄とします。 ロ)投資候補銘柄の中から、成長性やバリュエーションを考慮し、投資魅力の高い銘柄を選定します。 ハ)個別銘柄の流動性、株価水準等を考慮し、ポートフォリオを構築します。 ニ)投資候補銘柄およびポートフォリオの組入銘柄については、適宜見直しを行ないます。 3．株式の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 4．運用の効率化を図るため、わが国の株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数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。 5．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。
信託期間	2027年4月8日まで(2017年7月31日当初設定)
決算日	3月、9月の各24日（休業日の場合翌営業日）

運用管理費用 （信託報酬）	純資産総額に対し、年率0.583%（税抜0.53%）を乗じて得た額とします。 ※運用管理費用（信託報酬）の他に、信託事務の諸費用、監査報酬、およびその他諸費用がかかります。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

3. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

基本方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等
投資態度	1. 主として海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 2. 海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。 イ）米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。 ※ 北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ ※ 東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等 ロ）ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします（ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。）。 ハ）国債については、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでA3以上またはS&PでA－以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上（ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA－以上）とすることを基本とします。 ニ）ポートフォリオの修正デュレーションは5(年)程度から10(年)程度の範囲を基本とします。 ホ）金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。 3. 為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。 4. 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。

信託期間	無期限（2005年4月26日当初設定）
決算日	4月、10月の各10日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

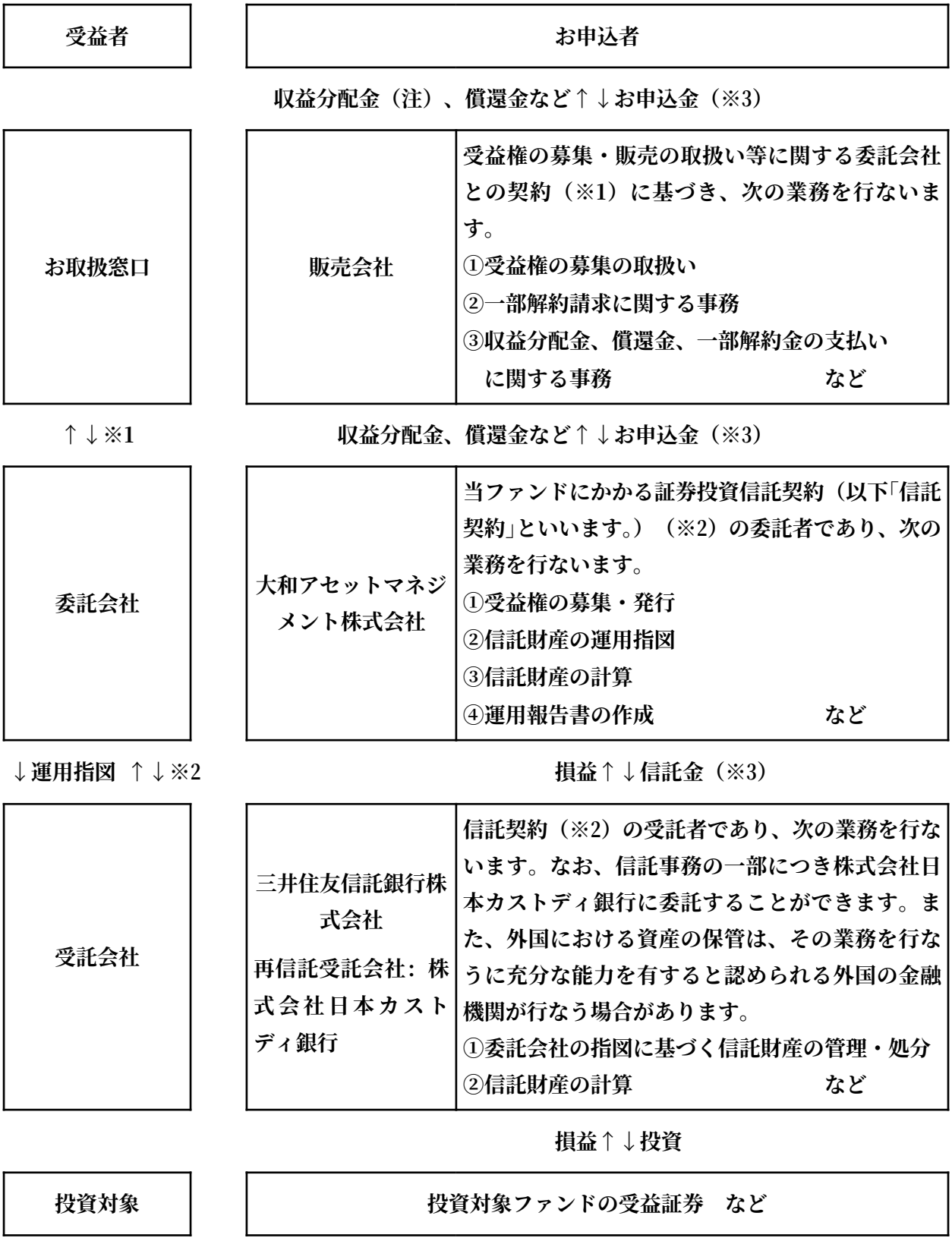
4. ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド

基本方針	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。
主要投資対象	先進国通貨建て債券
投資態度	1．　主として、先進国通貨建て債券に投資し、為替変動リスクを低減するための為替ヘッジを行なうことにより、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。 2．　組入れる債券（国債を除きます。）の格付けは、取得時においてBBB格相当以上（R&I、JCR、S&P、フィッチのいずれかでBBB-以上またはムーディーズでBaa3以上）とします。 ※当ファンドにおいて先進国通貨とはFTSE世界国債インデックスの構成通貨をいいます。 3．　対円で為替ヘッジを行なうことを前提に、各国の長短金利の状況、信用環境、流動性等を考慮しポートフォリオを構築します。 4．　債券の組入比率は、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。 5．　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、債券の組入総額および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。また、債券先物取引等の売建玉の時価総額が債券の組入総額を超えることがあります。 6．　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。
信託期間	無期限（2014年11月14日当初設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

(2)【ファンドの沿革】

2017年7月28日　　信託契約締結、当初設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、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（2023年4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	%
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	2,608,525	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

次の受益証券（振替受益権を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

イ．四国応援マザーファンドの受益証券

ロ．地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）の受益証券

ハ．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

ニ．ネオ・ヘッジ付債券マザーファンドの受益証券

②　投資態度

１．主として、各投資対象ファンドの受益証券を通じて、わが国の株式および海外の債券に投資することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

２．各主要投資対象ファンドの受益証券については、下記の組入比率を目処に投資を行ないます。

四国応援マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の25%

地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）の受益証券

……信託財産の純資産総額の25%

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の25%

ネオ・ヘッジ付債券マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の25%

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

＜投資先ファンドについて＞

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	**地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）**
選定の方針	**主として、わが国の株式の中から地方創生に貢献する、または地方創生から恩恵を受けると考えられる企業（金融業を除く。）に投資することにより信託財産の成長をめざすファンドである。**

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

(2)【投資対象】

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から3．までに掲げる親投資信託の受益証券、次の4．に掲げる証券投資信託の受益証券（振替受益権を含みます。）、ならびに次の5．から7．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．四国応援マザーファンドの受益証券
2．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3．ネオ・ヘッジ付債券マザーファンドの受益証券
4．地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）の受益証券
5．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
6．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.の証券の性質を有するもの
7．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.から前4.までの受益証券を「投資信託証券」といいます。

③ 委託会社は、信託金を、前②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

④ 前②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

＜投資先ファンドについて＞

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

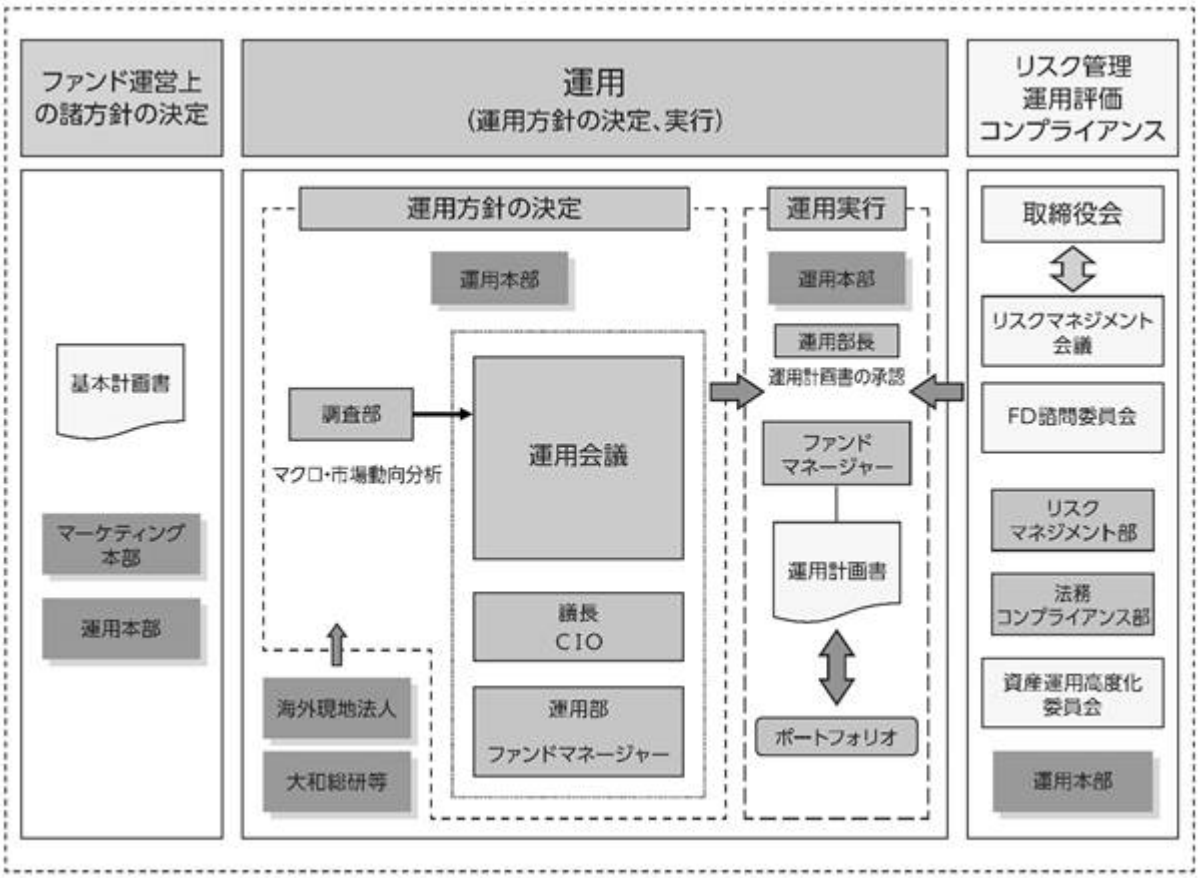
投資先ファンドの名称	**地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）**
運用の基本方針	**信託財産の成長をめざして運用を行ないます。**
主要な投資対象	**地方創生マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、地方創生企業に投資します。**
委託会社の名称	**大和アセットマネジメント株式会社**

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

(3)【運用体制】

① 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。



② 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。

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・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。

④　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35～45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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2023年4月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

④　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。

⑤　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞投資対象ファンドについて

※下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

1．四国応援マザーファンド

主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権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。 ⑤　外貨建資産への投資は、行ないません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

２．地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

主な投資制限	①　マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ②　株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ③　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④　投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥　外貨建資産への投資は、行ないません。
収益分配方針	①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 ③　留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。
販売手数料	ありません。
償還条項	受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

３．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（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。）の行使等により取得したものに限ります。 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。 ②　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。 ③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

４．ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド

主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 　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。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

３【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、公社債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。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投

資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドは時価総額が小さい企業の株式に投資することがあります。時価総額が小さい企業の株式については、株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動するリスクがあり、当ファンドの基準価額に影響する可能性があります。

② 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。

③ 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。

＜ファンドの特色＞1．③の外貨建て資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

＜ファンドの特色＞1．④の外貨建ての資産については、為替変動リスクの低減のために、為替ヘッジを行ないます。ただし、影響をすべて排除できるわけではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

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。

④ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 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発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

② 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することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受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。

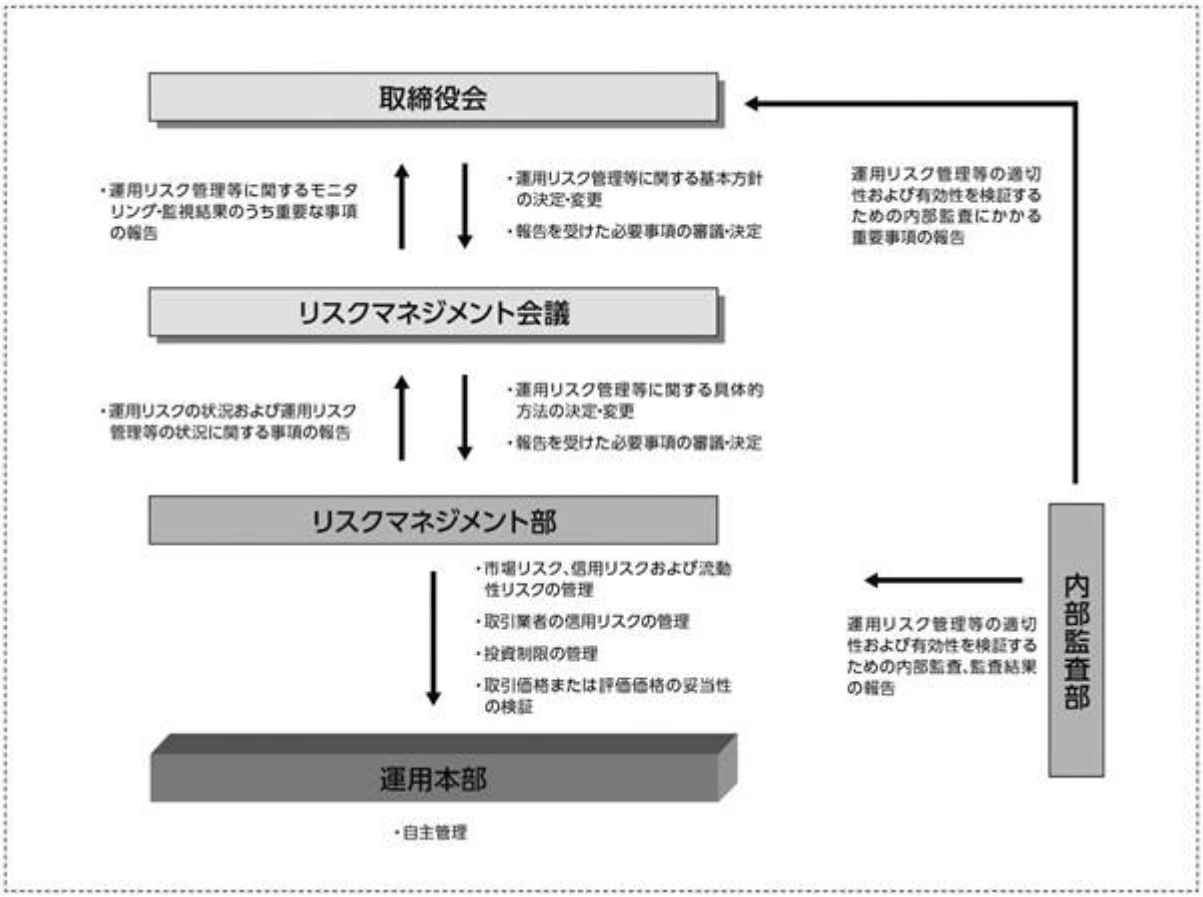
※ 流動性リスクに関する事項

・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要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・検証などを行ないます。

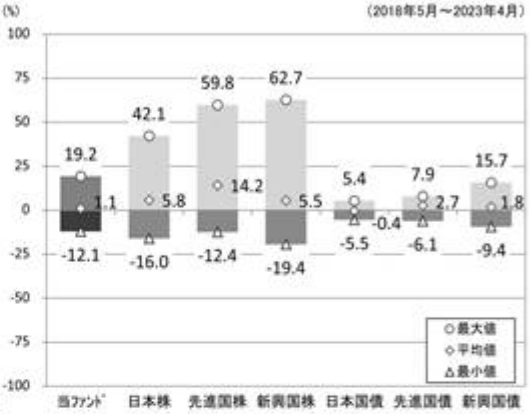
・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて
日 本 株：配当込みTOPIX
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― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について
●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●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.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。［https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html］●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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同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― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、販売会社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。
「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.9955％（税抜0.905%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、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。

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。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.375% （税抜）	年率0.50% （税抜）	年率0.03% （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。

④ 前③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。

⑤ 投資対象ファンドの信託報酬等については、「１　ファンドの性格　(1)ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」の＜投資対象ファンドの概要＞をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率1.14125%（税込）程度です。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。
委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

① 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。
② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
③ 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。
④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜投資対象ファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」の適用対象です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

①　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。

②　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。

③　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。

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

①　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。

②　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、2023年4月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2023年4月28日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		195,988,018	24.73
	内 日本	195,988,018	24.73
親投資信託受益証券		590,329,988	74.48
	内 日本	590,329,988	74.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,316,354	0.80
純資産総額		792,634,360	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】(2023年4月28日現在)

①【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	四国応援マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	158,676,323	1.2005 190,490,928	1.2533 198,869,035	25.09
2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	106,431,434	1.8437 196,227,637	1.8473 196,610,788	24.80
3	地方創生ファンド	日本	投資信託受益証券	162,632,162	1.1707 190,394,798	1.2051 195,988,018	24.73
4	ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	193,035,631	1.0226 197,417,488	1.0094 194,850,165	24.58

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	24.73%
親投資信託受益証券	74.48%

合計	99.20%

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年10月10日)	2,903,924,738	2,923,860,479	1.0196	1.0266
第2計算期間末 (2018年4月10日)	2,763,584,653	2,776,928,697	1.0355	1.0405
第3計算期間末 (2018年10月10日)	2,972,171,917	2,972,171,917	1.0231	1.0231
第4計算期間末 (2019年4月10日)	2,865,680,564	2,865,680,564	0.9991	0.9991
第5計算期間末 (2019年10月10日)	2,712,375,556	2,712,375,556	1.0014	1.0014
第6計算期間末 (2020年4月10日)	1,693,756,971	1,693,756,971	0.9912	0.9912
第7計算期間末 (2020年10月12日)	1,433,481,669	1,466,592,675	1.0823	1.1073
第8計算期間末 (2021年4月12日)	1,174,242,990	1,261,810,084	1.0728	1.1528
第9計算期間末 (2021年10月11日)	1,059,989,143	1,065,019,890	1.0535	1.0585
第10計算期間末 (2022年4月11日)	898,411,723	900,249,314	0.9778	0.9798
2022年4月末日	889,462,180	－	0.9676	－

5月末日	886,179,066	－	0.9720	－
6月末日	870,895,390	－	0.9573	－
7月末日	879,915,425	－	0.9846	－
8月末日	858,978,003	－	0.9751	－
9月末日	816,867,034	－	0.9405	－
第11計算期間末 (2022年10月11日)	817,048,701	818,788,644	0.9392	0.9412
10月末日	819,836,240	－	0.9528	－
11月末日	835,727,081	－	0.9795	－
12月末日	795,007,619	－	0.9349	－
2023年1月末日	816,693,355	－	0.9616	－
2月末日	796,253,572	－	0.9629	－
3月末日	806,781,833	－	0.9779	－
第12計算期間末 (2023年4月10日)	797,221,029	801,347,033	0.9661	0.9711
4月末日	792,634,360	－	0.9804	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0050
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0250
第8計算期間	0.0800
第9計算期間	0.0050
第10計算期間	0.0020
第11計算期間	0.0020
第12計算期間	0.0050

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	2.0
第3計算期間	△1.2
第4計算期間	△2.3
第5計算期間	0.2

第6計算期間	△1.0
第7計算期間	11.7
第8計算期間	6.5
第9計算期間	△1.3
第10計算期間	△7.0
第11計算期間	△3.7
第12計算期間	3.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	825,977,678	99,528,459
第2計算期間	777,152,707	956,306,916
第3計算期間	445,709,406	209,473,558
第4計算期間	109,480,514	146,350,330
第5計算期間	11,200,530	170,781,909
第6計算期間	17,648,574	1,017,493,257
第7計算期間	18,074,408	402,382,967
第8計算期間	20,572,756	250,424,321
第9計算期間	62,345,879	150,785,141
第10計算期間	10,962,001	98,315,862
第11計算期間	7,686,719	56,510,394
第12計算期間	5,611,500	50,382,419

(注)　当初設定数量は2,121,513,819口です。

（参考）マザーファンド

四国応援マザーファンド

(1) 投資状況（2023年4月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,114,518,760	97.76
	内 日本	1,114,518,760	97.76
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		25,576,890	2.24
純資産総額		1,140,095,650	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(%)

株価指数先物取引(買建)		22,638,000	1.99
	内 日本	22,638,000	1.99

(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) 株価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（2023年4月28日現在）

① 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	三浦工業	日本	株式	機械	28,100	3,275.00 92,027,500	3,610.00 101,441,000	8.90
2	ユニ･チャーム	日本	株式	化学	18,100	5,294.00 95,821,400	5,476.00 99,115,600	8.69
3	富 士 通	日本	株式	電気機器	5,000	17,095.00 85,475,000	18,060.00 90,300,000	7.92
4	三菱電機	日本	株式	電気機器	51,700	1,532.00 79,204,400	1,679.00 86,804,300	7.61
5	日本製鉄	日本	株式	鉄鋼	22,900	2,960.50 67,795,450	2,893.00 66,249,700	5.81
6	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	13,400	4,286.00 57,432,400	4,601.00 61,653,400	5.41
7	イオン	日本	株式	小売業	20,900	2,552.00 53,336,800	2,767.50 57,840,750	5.07
8	ジャストシステム	日本	株式	情報･通信業	15,400	3,525.00 54,285,000	3,580.00 55,132,000	4.84
9	大王製紙	日本	株式	パルプ･紙	40,700	1,065.00 43,345,500	1,100.00 44,770,000	3.93
10	四国電力	日本	株式	電気･ガス業	50,000	767.00 38,350,000	803.00 40,150,000	3.52
11	フ ジ	日本	株式	小売業	20,900	1,708.00 35,697,200	1,773.00 37,055,700	3.25
12	住友鉱山	日本	株式	非鉄金属	7,000	5,079.00 35,553,000	5,009.00 35,063,000	3.08
13	タダノ	日本	株式	機械	31,200	1,016.00 31,699,200	1,058.00 33,009,600	2.90

14	東レ	日本	株式	繊維製品	39,300	743.70 29,227,410	767.70 30,170,610	2.65
15	住友化学	日本	株式	化学	40,100	449.00 18,004,900	458.00 18,365,800	1.61
16	四国化成ホールディンク	日本	株式	化学	12,800	1,354.00 17,331,200	1,413.00 18,086,400	1.59
17	技研製作所	日本	株式	機械	6,800	2,251.00 15,306,800	2,131.00 14,490,800	1.27
18	王子ホールディングス	日本	株式	パルプ･紙	24,600	520.00 12,792,000	533.00 13,111,800	1.15
19	川崎重工業	日本	株式	輸送用機器	4,100	2,867.00 11,754,700	2,938.00 12,045,800	1.06
20	クラレ	日本	株式	化学	8,600	1,198.00 10,302,800	1,267.00 10,896,200	0.96
21	住友重機械	日本	株式	機械	3,000	3,120.00 9,360,000	3,270.00 9,810,000	0.86
22	電源開発	日本	株式	電気･ガス業	4,500	2,130.00 9,585,000	2,173.00 9,778,500	0.86
23	ジェイテクト	日本	株式	機械	8,300	1,005.00 8,341,500	1,115.00 9,254,500	0.81
24	住友ファーマ	日本	株式	医薬品	9,600	843.00 8,092,800	851.00 8,169,600	0.72
25	四電工	日本	株式	建設業	4,000	1,867.00 7,468,000	1,951.00 7,804,000	0.68
26	帝人	日本	株式	繊維製品	4,900	1,439.00 7,051,100	1,513.00 7,413,700	0.65
27	太平洋セメント	日本	株式	ガラス･土石製品	3,000	2,356.00 7,068,000	2,430.00 7,290,000	0.64
28	三菱マテリアル	日本	株式	非鉄金属	3,200	2,167.00 6,934,400	2,220.00 7,104,000	0.62
29	井関農機	日本	株式	機械	5,700	1,159.00 6,606,300	1,197.00 6,822,900	0.60
30	穴吹興産	日本	株式	不動産業	2,800	2,246.00 6,288,800	2,319.00 6,493,200	0.57

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.76%
合計	97.76%

(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
水産・農林業	0.24%
鉱業	0.13%
建設業	1.27%
食料品	0.16%
繊維製品	3.41%
パルプ・紙	6.06%
化学	14.48%
医薬品	6.12%
ゴム製品	0.49%
ガラス・土石製品	1.13%
鉄鋼	6.49%
非鉄金属	3.70%
機械	15.57%
電気機器	16.52%
輸送用機器	1.24%
その他製品	1.23%
電気・ガス業	4.38%
情報・通信業	5.22%
卸売業	0.59%
小売業	8.69%
不動産業	0.57%
サービス業	0.06%
合計	97.76%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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
株価指数先物取引	日本	ミニＴＰＸ先物　０５０６月	買建	11	21,752,500	22,638,000	1.99%

(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) 株価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。

（参考）投資信託証券

地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

(1) 投資状況（2023年4月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		1,137,815,437	99.90
	内 日本	1,137,815,437	99.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,112,356	0.10
純資産総額		1,138,927,793	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（2023年4月28日現在）

① 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	地方創生マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	626,653,873	1.7248 1,080,896,322	1.8157 1,137,815,437	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.90%
合計	99.90%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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〉マザーファンド

地方創生マザーファンド

(1) 投資状況（2023年4月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		2,527,879,400	95.26
	内 日本	2,527,879,400	95.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		125,854,437	4.74
純資産総額		2,653,733,837	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（2023年4月28日現在）

① 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	ゴールドウイン	日本	株式	繊維製品	4,500	11,610.00 52,245,000	12,330.00 55,485,000	2.09
2	イビデン	日本	株式	電気機器	10,000	5,030.00 50,300,000	5,320.00 53,200,000	2.00
3	IDEC	日本	株式	電気機器	16,000	3,355.00 53,680,000	3,310.00 52,960,000	2.00
4	MARUWA	日本	株式	ガラス・土石製品	3,000	17,550.00 52,650,000	17,250.00 51,750,000	1.95
5	旭有機材	日本	株式	化学	16,200	3,080.24 49,900,011	3,175.00 51,435,000	1.94
6	物語コーポレーション	日本	株式	小売業	18,000	2,646.00 47,628,000	2,857.00 51,426,000	1.94

7	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	16,000	2,142.00 34,272,000	2,555.00 40,880,000	1.54
8	マニー	日本	株式	精密機器	23,000	1,777.00 40,871,000	1,768.00 40,664,000	1.53
9	エフピコ	日本	株式	化学	12,000	3,135.00 37,620,000	3,370.00 40,440,000	1.52
10	ダイセキ	日本	株式	サービス業	10,000	3,905.00 39,050,000	3,875.00 38,750,000	1.46
11	デクセリアルズ	日本	株式	化学	15,000	2,589.00 38,835,000	2,566.00 38,490,000	1.45
12	日本新薬	日本	株式	医薬品	6,000	5,910.00 35,460,000	6,200.00 37,200,000	1.40
13	セーレン	日本	株式	繊維製品	16,200	2,250.00 36,450,000	2,250.00 36,450,000	1.37
14	九電工	日本	株式	建設業	10,000	3,340.00 33,400,000	3,615.00 36,150,000	1.36
15	九州旅客鉄道	日本	株式	陸運業	11,600	2,964.36 34,386,678	3,085.00 35,786,000	1.35
16	上 組	日本	株式	倉庫･運輸関連業	12,000	2,704.00 32,448,000	2,975.00 35,700,000	1.35
17	アシックス	日本	株式	その他製品	9,300	3,515.00 32,689,500	3,775.00 35,107,500	1.32
18	芝浦機械	日本	株式	機械	11,000	2,985.00 32,835,000	3,150.00 34,650,000	1.31
19	大塚商会	日本	株式	情報･通信業	7,000	4,490.00 31,430,000	4,935.00 34,545,000	1.30
20	トヨタ紡織	日本	株式	輸送用機器	16,000	2,025.00 32,400,000	2,139.00 34,224,000	1.29
21	第一興商	日本	株式	卸売業	14,000	2,135.00 29,890,000	2,430.00 34,020,000	1.28
22	タ ク マ	日本	株式	機械	24,000	1,297.00 31,128,000	1,416.00 33,984,000	1.28
23	東急不動産HD	日本	株式	不動産業	49,000	623.00 30,527,000	687.00 33,663,000	1.27
24	マクニカホールディングス	日本	株式	卸売業	9,000	3,610.00 32,490,000	3,715.00 33,435,000	1.26
25	パルグループHLDGS	日本	株式	小売業	10,700	2,984.28 31,931,830	3,115.00 33,330,500	1.26
26	マクセル	日本	株式	電気機器	22,000	1,546.00 34,012,000	1,493.00 32,846,000	1.24

27	東亞合成	日本	株式	化学	28,000	1,188.00 33,264,000	1,170.00 32,760,000	1.23
28	スター精密	日本	株式	機械	18,600	1,740.34 32,370,475	1,760.00 32,736,000	1.23
29	BIPROGY	日本	株式	情報･通信業	10,000	3,185.00 31,850,000	3,270.00 32,700,000	1.23
30	光通信	日本	株式	情報･通信業	1,700	18,440.00 31,348,000	18,480.00 31,416,000	1.18

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.26%
合計	95.26%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	3.03%
食料品	1.16%
繊維製品	5.39%
化学	11.52%
医薬品	1.40%
ゴム製品	1.11%
ガラス・土石製品	1.95%
鉄鋼	3.92%
非鉄金属	2.45%
金属製品	0.79%
機械	9.80%
電気機器	7.05%
輸送用機器	4.64%
精密機器	1.53%
その他製品	3.91%
電気・ガス業	1.61%
陸運業	3.31%
倉庫・運輸関連業	1.35%
情報・通信業	5.55%
卸売業	6.20%
小売業	4.39%

不動産業	3.15%
サービス業	10.04%
合計	95.26%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年4月28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		14,592,839,203	87.62
	内　ユーロ	4,298,975,481	25.81
	内　ノルウェー	251,442,464	1.51
	内　スウェーデン	350,933,018	2.11
	内　デンマーク	524,077,974	3.15
	内　イギリス	1,935,006,902	11.62
	内　ポーランド	1,172,786,930	7.04
	内　カナダ	986,641,844	5.92
	内　アメリカ	3,961,493,377	23.78
	内　オーストラリア	1,111,481,213	6.67
特殊債券		1,633,269,871	9.81
	内　カナダ	1,031,499,821	6.19
	内　オーストラリア	601,770,050	3.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		429,398,064	2.58
純資産総額		16,655,507,138	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）		675,441,487	4.06
	内　日本	675,441,487	4.06

為替予約取引(売建)		731,866,746	△4.39
	内 日本	731,866,746	△4.39

(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（2023年4月28日現在）

① 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	19,807,400	83.50 2,218,586,051	82.82 2,200,546,607	0.875000 2030/11/15	13.21
2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	93.35 1,262,620,250	92.20 1,247,026,001	1.400000 2028/04/30	7.49
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,210,400	102.43 941,728,735	98.22 903,105,260	3.250000 2045/05/25	5.42
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	8,500,000	111.22 841,235,605	109.54 828,529,261	4.500000 2033/04/21	4.97
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,660,000	97.79 819,455,701	96.93 812,216,189	1.950000 2026/04/30	4.88
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,307,800	94.77 801,875,227	94.41 798,846,314	2.250000 2027/08/15	4.80
7	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	86.21 697,843,560	86.52 700,417,643	2.750000 2028/04/25	4.21
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	66.99 690,636,056	65.62 676,553,646	1.125000 2040/08/15	4.06
9	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	6,230,000	96.71 593,893,643	96.30 591,382,011	2.250000 2025/12/15	3.55
10	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	7,046,000	84.64 587,893,916	83.59 580,608,357	0.500000 2030/12/01	3.49
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	91.80 492,531,558	90.05 483,132,428	1.625000 2028/10/22	2.90
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,020,000	94.30 477,484,233	93.26 472,193,366	1.500000 2026/07/22	2.84
13	INTL. FIN. CORP.	オーストラリア	特殊債券	5,600,000	80.37 400,509,212	80.20 399,631,958	1.250000 2031/02/06	2.40

14	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	77.70 403,284,368	75.62 392,463,342	0.250000 2031/07/31	2.36
15	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	97.88 392,683,200	97.36 390,589,082	1.750000 2025/11/15	2.35
16	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	92.31 326,279,206	91.47 323,338,415	1.100000 2029/05/15	1.94
17	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	108.18 312,291,860	103.97 300,164,497	3.750000 2045/06/22	1.80
18	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	3,000,000	102.50 303,105,707	101.23 299,350,190	3.550000 2032/09/15	1.80
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	5,000,000	64.99 289,152,967	63.59 282,951,951	1.750000 2051/06/21	1.70
20	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	99.61 251,836,832	99.46 251,442,464	3.000000 2024/03/14	1.51
21	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	2,500,000	91.31 203,130,217	90.86 202,138,090	1.100000 2026/12/16	1.21
22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,000,000	72.08 186,706,805	72.79 188,551,079	1.250000 2030/10/25	1.13
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,000,000	90.17 175,173,619	90.69 176,183,825	0.750000 2025/04/25	1.06
24	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	98.82 175,653,920	98.87 175,741,011	1.500000 2023/11/13	1.06
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	95.06 176,401,853	94.41 175,192,007	1.000000 2026/11/12	1.05
26	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	106.95 179,306,704	101.13 169,559,533	4.250000 2046/12/07	1.02
27	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	1,172,000	95.61 165,899,983	94.98 164,798,240	1.000000 2026/05/15	0.99
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,400,000	78.77 163,255,551	76.99 159,570,539	— 2032/05/25	0.96
29	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,800,000	56.89 171,686,006	52.59 158,700,843	1.250000 2051/07/31	0.95
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,100,000	54.31 168,856,644	50.98 158,497,989	0.750000 2053/05/25	0.95

(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	87.62%
特殊債券	9.81%

合計	97.42%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	ノルウェー・クローネ買/円売 2023年5月	買建	22,000,000	278,492,153	277,178,000	1.66%
		豪ドル買/円売 2023年5月	買建	1,158,160	102,739,000	102,671,213	0.62%
		米ドル買/円売 2023年5月	買建	2,214,677	293,540,000	295,592,274	1.77%
		米ドル売/円買 2023年5月	売建	400,000	53,408,800	53,628,000	△0.32%
		ユーロ売/円買 2023年5月	売建	2,700,000	396,279,000	398,480,850	△2.39%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2023年5月	売建	8,717,236	278,492,153	279,757,896	△1.68%

(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。

ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド

(1) 投資状況（2023年4月28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		22,226,434,687	67.45
	内 ユーロ	10,097,818,022	30.64
	内 イギリス	794,106,414	2.41

	内 ポーランド	47,137,770	0.14
	内 アメリカ	11,147,109,585	33.83
	内 メキシコ	140,262,896	0.43
地方債証券		258,994,647	0.79
	内 カナダ	258,994,647	0.79
特殊債券		854,612,541	2.59
	内 ユーロ	462,814,491	1.40
	内 イギリス	391,798,050	1.19
社債券		9,209,858,070	27.95
	内 ユーロ	183,469,969	0.56
	内 スウェーデン	123,750,904	0.38
	内 イギリス	442,965,836	1.34
	内 アメリカ	6,139,199,312	18.63
	内 オーストラリア	2,320,472,049	7.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		401,599,943	1.22
純資産総額		32,951,499,888	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		33,403,686,260	△101.37
	内 日本	33,403,686,260	△101.37

(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（2023年4月28日現在）

① 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	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	29,000,000	105.07 4,510,994,938	102.49 4,400,274,342	4.500000 2026/03/01	13.35
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	24,000,000	74.93 2,412,094,496	74.25 2,390,228,791	1.875000 2041/02/15	7.25
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	19,000,000	87.03 2,218,036,470	87.48 2,229,401,556	0.750000 2028/01/31	6.77
4	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,500,000	83.71 1,920,941,133	84.44 1,937,623,020	1.650000 2030/12/01	5.88

5	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	11,000,000	74.15 1,207,504,544	75.72 1,233,168,758	0.600000 2031/08/01	3.74
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	12,500,000	76.39 1,280,877,368	73.46 1,231,715,790	2.250000 2052/02/15	3.74
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,100,000	90.45 1,104,033,134	91.06 1,111,511,703	0.500000 2026/02/28	3.37
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.20 1,064,531,128	99.78 1,070,775,885	3.500000 2033/02/15	3.25
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	90.27 968,643,896	93.89 1,007,563,099	2.750000 2032/08/15	3.06
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	96.99 585,429,163	91.54 552,569,995	3.250000 2042/05/15	1.68
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,000,000	89.89 532,339,996	90.86 538,089,870	1.100000 2027/04/01	1.63
12	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,500,000	112.75 584,223,575	99.12 513,616,637	2.750000 2047/01/15	1.56
13	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,000,000	119.67 531,500,610	110.50 490,792,570	4.700000 2041/07/30	1.49
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	86.84 465,951,524	87.69 470,501,214	1.875000 2032/02/15	1.43
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	3,500,000	100.66 472,577,715	99.92 469,084,130	3.875000 2043/02/15	1.42
16	European Union	ユーロ	特殊債券	4,000,000	80.33 475,717,657	78.15 462,814,491	— 2031/07/04	1.40
17	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,000,000	84.67 425,867,883	78.69 395,786,443	0.375000 2030/10/22	1.20
18	BNG Bank NV	イギリス	特殊債券	2,500,000	96.63 405,038,208	93.48 391,798,050	1.625000 2025/08/26	1.19
19	AT&T Inc	オーストラリア	社債券	4,300,000	94.46 361,436,315	99.51 380,769,800	4.600000 2028/09/19	1.16
20	BANK OF AMERICA CORP.	アメリカ	社債券	3,000,000	93.01 374,299,154	93.83 377,582,656	3.593000 2028/07/21	1.15
21	AMAZON.COM INC	アメリカ	社債券	3,000,000	86.29 347,230,378	88.57 356,400,846	1.650000 2028/05/12	1.08
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,000,000	86.58 348,428,871	86.98 349,998,822	0.500000 2027/10/31	1.06
23	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	アメリカ	社債券	3,000,000	79.50 319,920,169	80.19 322,704,708	2.309000 2032/07/20	0.98
24	Verizon Communications Inc	オーストラリア	社債券	3,500,000	95.22 296,565,446	100.16 311,937,630	4.500000 2027/08/17	0.95

25	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,000,000	96.88 286,851,186	97.47 288,592,136	— 2024/01/30	0.88
26	BPCE SA	オーストラリア	社債券	3,500,000	92.15 287,007,659	92.03 286,637,057	4.500000 2028/04/26	0.87
27	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	アメリカ	社債券	2,500,000	82.72 277,384,193	84.96 284,915,592	1.902000 2028/09/17	0.86
28	STANDARD CHARTERED PLC	アメリカ	社債券	2,000,000	100.00 268,260,000	102.89 276,026,127	7.776000 2025/11/16	0.84
29	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	2,000,000	95.88 257,213,053	98.32 263,758,597	4.500000 2029/04/22	0.80
30	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK	アメリカ	社債券	2,000,000	96.61 259,187,446	97.46 261,451,561	3.905000 2027/06/09	0.79

(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	67.45%
地方債証券	0.79%
特殊債券	2.59%
社債券	27.95%
合計	98.78%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	メキシコ・ペソ売/円買 2023年5月	売建	19,600,000	142,707,600	145,096,840	△0.44%
		英ポンド売/円買 2023年5月	売建	10,000,000	1,638,429,000	1,674,128,000	△5.08%
		豪ドル売/円買 2023年5月	売建	27,200,000	2,415,169,600	2,417,264,000	△7.34%

		ポーランド・ズロチ売/円買 2023年5月	売建	500,000	15,333,400	16,141,300	△0.05%
		米ドル売/円買 2023年5月	売建	131,500,000	17,433,373,383	17,609,165,000	△53.44%
		ユーロ売/円買 2023年5月	売建	75,300,000	10,853,937,780	11,136,026,640	△33.80%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2023年5月	売建	10,000,000	127,916,000	130,263,000	△0.40%
		カナダ・ドル売/円買 2023年5月	売建	2,800,000	274,092,000	275,601,480	△0.84%

(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。

（参考情報）運用実績

● 四国アライアンス 地域創生ファンド(年2回決算型)

2023年4月28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	9,804円
純資産総額	7.9億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	2.5%
6カ月間	3.4%
1年間	2.1%
3年間	8.1%
5年間	4.6%
設定来	10.6%

※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:　70円　　設定来分配金合計額:　1,310円

決算期	第1期 17年10月	第2期 18年4月	第3期 18年10月	第4期 19年4月	第5期 19年10月	第6期 20年4月	第7期 20年10月	第8期 21年4月	第9期 21年10月	第10期 22年4月	第11期 22年10月	第12期 23年4月
分配金	70円	50円	0円	0円	0円	0円	250円	800円	50円	20円	20円	50円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	123	48.4%
国内株式	175	48.0%
国内株式 先物	1	0.5%
コール・ローン、その他		3.6%
合計	299	-

通貨別構成	比率
日本円	75.3%
米ドル	6.6%
ユーロ	6.0%
カナダ・ドル	3.0%
英ポンド	2.9%
豪ドル	2.7%
ポーランド・ズロチ	1.4%
ノルウェー・クローネ	0.8%
デンマーク・クローネ	0.8%
その他	0.5%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.5
最終利回り(%)	3.9
修正デュレーション	7.3
残存年数	8.9

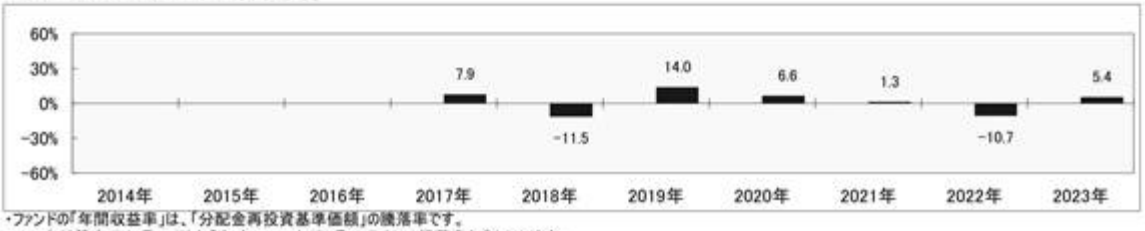
債券格付別構成	比率
AAA	59.2%
AA	14.5%
A	24.2%
BBB	2.2%
BB	-
合計	100.0%

組入上位銘柄(除く債券)	東証33業種名	比率
三浦工業	機械	2.2%
ユニ・チャーム	化学	2.2%
富士通	電気機器	2.0%
三菱電機	電気機器	1.9%
日本製鉄	鉄鋼	1.5%
大塚ホールディングス	医薬品	1.4%
イオン	小売業	1.3%
ジャストシステム	情報・通信業	1.2%
大王製紙	パルプ・紙	1.0%
四国電力	電気・ガス業	0.9%
合計		15.5%

※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。
※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。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2017年は設定日(7月28日)から年末、2023年は4月28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。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	1.16%	1.00%	0.17%

※対象期間は2022年10月12日～2023年4月10日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※その他費用には、投資先ファンドにかかる費用が含まれています。
※投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。
※投資先ファンドの費用について、計上された期間が異なる場合があります。
※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ロンドンの銀行、ニューヨークの銀行、シカゴ商品取引所における米国債先物取引、ユーレックス・ドイツにおけるドイツ国債先物取引またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパにおけるイギリス国債先物取引のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

お買付価額（１万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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

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

＜一部解約＞

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

ただし、販売会社は、ロンドンの銀行、ニューヨークの銀行、シカゴ商品取引所における米国債先物取引、ユーレックス・ドイツにおけるドイツ国債先物取引またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパにおけるイギリス国債先物取引のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または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、一部解約請求の受付けを中止することができます。

一部解約請求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一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受付けたものとして、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

・地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）の受益証券：計算日の前営業日の基準価額で評価します。

・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

・海外の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 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。）
2. 価格情報会社の提供する価額

・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。

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】

2017年7月28日から2027年4月9日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

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

(4)【計算期間】

毎年4月11日から10月10日まで、および10月11日から翌年4月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2017年7月28日から2017年10月10日までとし、最終計算期間は、2026年10月11日から2027年4月9日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意

のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 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。

7. 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、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

8. 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。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款

にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 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。

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間（2022年10月12日から2023年4月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 2022年10月11日現在	第12期 2023年4月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,446,895	14,382,208
投資信託受益証券	209,413,933	195,321,486
親投資信託受益証券	601,181,802	595,672,787
未収入金	401,000	－
流動資産合計	823,443,630	805,376,481
資産合計	823,443,630	805,376,481
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,739,943	4,126,004
未払解約金	284,032	－
未払受託者報酬	143,645	132,435
未払委託者報酬	4,191,475	3,863,985
その他未払費用	35,834	33,028
流動負債合計	6,394,929	8,155,452
負債合計	6,394,929	8,155,452
純資産の部		
元本等		
元本	※1 869,971,877	※1 825,200,958
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 52,923,176	※2 △ 27,979,929
（分配準備積立金）	44,917,433	46,654,949
元本等合計	817,048,701	797,221,029
純資産合計	817,048,701	797,221,029
負債純資産合計	823,443,630	805,376,481

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2022年4月12日 至　2022年10月11日	第12期 自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
営業収益		
受取配当金	―	2,492,660
受取利息	―	2
有価証券売買等損益	△ 27,746,263	28,732,538
営業収益合計	△ 27,746,263	31,225,200
営業費用		
支払利息	1,107	1,378
受託者報酬	143,645	132,435
委託者報酬	4,191,475	3,863,985
その他費用	35,834	33,028
営業費用合計	4,372,061	4,030,826
営業利益又は営業損失（△）	△ 32,118,324	27,194,374
経常利益又は経常損失（△）	△ 32,118,324	27,194,374
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 32,118,324	27,194,374
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（△）	△ 362,878	929,827
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 20,383,829	△ 52,923,176
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,257,884	3,063,852
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,257,884	3,063,852
剰余金減少額又は欠損金増加額	301,842	259,148
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	301,842	259,148
分配金	※1 1,739,943	※1 4,126,004
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 52,923,176	△ 27,979,929

(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12期 自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 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、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。 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)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．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。
3．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 2022年10月10日が休日のため、前計算期間末日を2022年10月11日としております。このため、当計算期間は181日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第11期 2022年10月11日現在	第12期 2023年4月10日現在
1．※1　期首元本額	918,795,552円	869,971,877円
期中追加設定元本額	7,686,719円	5,611,500円
期中一部解約元本額	56,510,394円	50,382,419円

2. 計算期間末日における受益権の総数	869,971,877口	825,200,958口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は52,923,176円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は27,979,929円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第11期 自　2022年4月12日 至　2022年10月11日	第12期 自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,396,232円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,975,306円）及び分配準備積立金（44,261,144円）より分配対象額は59,632,682円（1万口当たり685.46円）であり、うち1,739,943円（1万口当たり20円）を分配金額としております。	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（8,458,244円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（17,175,277円）及び分配準備積立金（42,322,709円）より分配対象額は67,956,230円（1万口当たり823.51円）であり、うち4,126,004円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第12期 自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第12期 2023年4月10日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第11期 2022年10月11日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第12期 2023年4月10日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	12,774,281	2,149,794
親投資信託受益証券	△41,798,567	24,841,013
合計	△29,024,286	26,990,807

（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11期 2022年10月11日現在	第12期 2023年4月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第11期 2022年10月11日現在	第12期 2023年4月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9392円 (9,392円)	0.9661円 (9,661円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	166,841,622	195,321,486	
投資信託受益証券　合計			195,321,486	
親投資信託受益証券	ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド	193,025,803	197,407,488	
	四国応援マザーファンド	164,771,242	197,807,876	
	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	108,725,619	200,457,423	
親投資信託受益証券　合計			595,672,787	
合計			790,994,273	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「四国応援マザーファンド」受益証券、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券及び「ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「四国応援マザーファンド」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

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,471,158	11,849,141
株式　※2	1,059,917,250	1,089,734,170
未収配当金	9,159,200	10,124,670
前払金	―	460,500
流動資産合計	1,080,547,608	1,112,168,481
資産合計	1,080,547,608	1,112,168,481
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128,520	329,710
前受金	113,750	―
未払解約金	1,136,000	606,000
流動負債合計	1,378,270	935,710
負債合計	1,378,270	935,710
純資産の部		

元本等		
元本　※1	970,099,648	925,672,339
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	109,069,690	185,560,432
元本等合計	1,079,169,338	1,111,232,771
純資産合計	1,079,169,338	1,111,232,771
負債純資産合計	1,080,547,608	1,112,168,481

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1．※1　期首	2022年4月12日	2022年10月12日
期首元本額	927,863,367円	970,099,648円

期中追加設定元本額	69,187,416円	28,729,910円
期中一部解約元本額	26,951,135円	73,157,219円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	788,536,196円	760,901,097円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	181,563,452円	164,771,242円
計	970,099,648円	925,672,339円
2. 期末日における受益権の総数	970,099,648口	925,672,339口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　24,888,500円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　28,836,000円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2023年4月10日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2022年10月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年4月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△77,682,099	△7,835,624
合計	△77,682,099	△7,835,624

（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（2022年4月12日から2022年10月11日まで、及び2022年4月12日から2023年4月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2022年10月11日 現在				2023年4月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引 株価指数 先物取引								
買　建	13,224,750	－	13,097,000	△127,750	22,081,000	－	21,752,500	△328,500
合計	13,224,750	－	13,097,000	△127,750	22,081,000	－	21,752,500	△328,500

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1口当たり純資産額	1.1124円	1.2005円
（1万口当たり純資産額）	(11,124円)	(12,005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	
ホクト	800	1,834.00	1,467,200	
ベルグアース	400	3,375.00	1,350,000	
フィット	1,100	1,000.00	1,100,000	
日鉄鉱業	400	3,435.00	1,374,000	
三井住友建設	4,000	388.00	1,552,000	
東亜道路	400	3,900.00	1,560,000	
日本道路	200	7,400.00	1,480,000	
世紀東急	1,000	844.00	844,000	
四電工	4,000	1,867.00	7,468,000	
フィード・ワン	1,000	675.00	675,000	

システナ	11,200	276.00	3,091,200	
ＫＧ情報	1,800	394.00	709,200	
かどや製油	300	3,500.00	1,050,000	
ハローズ	500	3,065.00	1,532,500	
日清紡ホールディングス	4,200	990.00	4,158,000	
倉敷紡績	500	2,399.00	1,199,500	
ありがとうサービス	300	2,481.00	744,300	
帝　人	4,900	1,439.00	7,051,100	
東　レ	40,600	743.70	30,194,220	
ク　ラ　レ	8,800	1,198.00	10,542,400	
アクサスホールディングス	7,500	126.00	945,000	
ファインデックス	700	654.00	457,800	
ｅＢＡＳＥ	1,200	647.00	776,400	
王子ホールディングス	25,200	520.00	13,104,000	
大王製紙	41,200	1,065.00	43,878,000	
ニッポン高度紙工業	2,700	1,950.00	5,265,000	
レンゴー	6,700	843.00	5,648,100	
住友化学	41,200	449.00	18,498,800	
東亞合成	3,000	1,189.00	3,567,000	
大阪ソーダ	700	4,585.00	3,209,500	
四国化成ホールディンク	13,200	1,354.00	17,872,800	
大倉工業	3,100	2,050.00	6,355,000	
ダイキアクシス	3,400	692.00	2,352,800	
住友ファーマ	9,900	843.00	8,345,700	
大塚ホールディングス	13,700	4,286.00	58,718,200	
ジャストシステム	15,400	3,525.00	54,285,000	
ＯＡＴアグリオ	300	1,311.00	393,300	
アース製薬	500	4,710.00	2,355,000	
ニッタ	800	2,962.00	2,369,600	
三ツ星ベルト	800	3,810.00	3,048,000	
住友大阪セメント	900	3,560.00	3,204,000	
太平洋セメント	3,000	2,356.00	7,068,000	
日本興業	800	746.00	596,800	
東洋炭素	500	3,805.00	1,902,500	
日本製鉄	23,300	2,960.50	68,979,650	
丸一鋼管	2,100	2,847.00	5,978,700	
新日本電工	3,700	339.00	1,254,300	
三菱マテリアル	3,300	2,167.00	7,151,100	
住友鉱山	7,200	5,079.00	36,568,800	
三浦工業	29,800	3,275.00	97,595,000	

ＮＩＴＴＯＫＵ	400	2,759.00	1,103,600	
技研製作所	7,000	2,251.00	15,757,000	
住友重機械	3,100	3,120.00	9,672,000	
井関農機	5,700	1,159.00	6,606,300	
タダノ	32,200	1,016.00	32,715,200	
兼松エンジニアリング	1,400	1,198.00	1,677,200	
ジェイテクト	8,500	1,005.00	8,542,500	
三菱電機	52,600	1,532.00	80,583,200	※
富　士　通	5,000	17,095.00	85,475,000	
日本トリム	200	2,945.00	589,000	
アオイ電子	3,000	1,909.00	5,727,000	
大真空	900	695.00	625,500	
川崎重工業	4,200	2,867.00	12,041,400	
新明和工業	1,700	1,129.00	1,919,300	
マルヨシセンター	300	2,820.00	846,000	
ダイコー通産	1,300	1,243.00	1,615,900	
ニホンフラッシュ	6,200	969.00	6,007,800	
セキ	300	1,345.00	403,500	
レック	900	801.00	720,900	
南海プライウッド	300	5,900.00	1,770,000	
リンテック	1,900	2,157.00	4,098,300	
ミロク	800	1,521.00	1,216,800	
ユニ・チヤーム	18,800	5,294.00	99,527,200	※
イオン	20,900	2,552.00	53,336,800	
フ　ジ	21,200	1,708.00	36,209,600	
穴吹興産	2,900	2,246.00	6,513,400	
四国電力	50,600	767.00	38,810,200	
電源開発	4,500	2,130.00	9,585,000	
ヨンキュウ	1,700	2,551.00	4,336,700	
ジェコス	900	906.00	815,400	
合計			1,089,734,170	

（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。

三菱電機　　5,000株　　ユニ・チヤーム　　4,000株

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ファンドの経理状況

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、第12期計算期間（2022年9月27日から2023年3月24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。

その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

財務諸表

地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

	第11期 2022年9月26日現在	第12期 2023年3月24日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,275,009	4,137,728
親投資信託受益証券	1,068,477,554	1,085,529,598
未収入金	7,320,000	130,000
流動資産合計	1,080,072,563	1,089,797,326
資産合計	1,080,072,563	1,089,797,326
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	－	13,823,978

未払解約金	7,156,999	―
未払受託者報酬	124,805	118,730
未払委託者報酬	3,183,858	3,028,727
その他未払費用	31,119	29,602
流動負債合計	10,496,781	17,001,037
負債合計	10,496,781	17,001,037
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	957,264,912	921,598,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	112,310,870	151,197,697
（分配準備積立金）	217,998,141	199,893,541
元本等合計	1,069,575,782	1,072,796,289
純資産合計	1,069,575,782	1,072,796,289
負債純資産合計	1,080,072,563	1,089,797,326

(2) 損益及び剰余金計算書

	第11期 自 2022年3月25日 至 2022年9月26日	第12期 自 2022年9月27日 至 2023年3月24日
	金　額（円）	金　額（円）
営業収益		
受取利息	9	6
有価証券売買等損益	730,406	63,762,044
営業収益合計	730,415	63,762,050
営業費用		
支払利息	438	546
受託者報酬	124,805	118,730
委託者報酬	3,183,858	3,028,727
その他費用	31,119	29,602
営業費用合計	3,340,220	3,177,605
営業利益又は営業損失（△）	△2,609,805	60,584,445
経常利益又は経常損失（△）	△2,609,805	60,584,445
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,609,805	60,584,445
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	740,963	4,750,577
期首剰余金又は期首欠損金（△）	125,014,283	112,310,870
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,905,968	5,442,674

当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,905,968	5,442,674
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,258,613	8,565,737
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,258,613	8,565,737
分配金 ※1	－	13,823,978
期末剰余金又は期末欠損金（△）	112,310,870	151,197,697

(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12期 自　2022年9月27日 至　2023年3月24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 2022年9月24日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2022年9月26日としております。このため、当計算期間は179日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第11期 2022年9月26日現在	第12期 2023年3月24日現在
1．※1　期首元本額	1,022,146,277円	957,264,912円
期中追加設定元本額	36,266,036円	37,018,331円
期中一部解約元本額	101,147,401円	72,684,651円
2．計算期間末日における受益権の総数	957,264,912口	921,598,592口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第11期 自　2022年3月25日 至　2022年9月26日	第12期 自　2022年9月27日 至　2023年3月24日
※1　分配金の計算過程	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（9,317,372円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（100,658,385円）及び分配準備積立金（208,680,769円）より分配対象額は318,656,526円（1万口当たり3,328.82円）であり、分配を行っておりません。	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（11,942,836円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（105,066,072円）及び分配準備積立金（201,774,683円）より分配対象額は318,783,591円（1万口当たり3,459.03円）であり、うち13,823,978円（1万口当たり150円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第12期 自　2022年9月27日 至　2023年3月24日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第12期 2023年3月24日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第11期 2022年9月26日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第12期 2023年3月24日現在 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	△244,102	58,782,653
合計	△244,102	58,782,653

（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11期 2022年9月26日現在	第12期 2023年3月24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12期 自　2022年9月27日 至　2023年3月24日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第11期 2022年9月26日現在	第12期 2023年3月24日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1173円 (11,173円)	1.1641円 (11,641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	地方創生マザーファンド	629,621,019	1,085,529,598	
親投資信託受益証券　合計			1,085,529,598	
合計			1,085,529,598	

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。

〈参考情報〉

当ファンドは、「地方創生マザーファンド」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。

「地方創生マザーファンド」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

	2022年9月26日現在	2023年3月24日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	120,434,024	121,187,109
株式	2,312,234,600	2,384,718,800
未収入金	1,821,993	4,572,453
未収配当金	2,981,750	5,286,700
流動資産合計	2,437,472,367	2,515,765,062
資産合計	2,437,472,367	2,515,765,062
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,340,500	130,000
流動負債合計	7,340,500	130,000
負債合計	7,340,500	130,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	1,492,063,107	1,459,114,015
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	938,068,760	1,056,521,047
元本等合計	2,430,131,867	2,515,635,062
純資産合計	2,430,131,867	2,515,635,062
負債純資産合計	2,437,472,367	2,515,765,062

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年9月27日 至　2023年3月24日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年9月26日現在	2023年3月24日現在
1．※1　期首	2022年3月25日	2022年9月27日
期首元本額	1,532,587,497円	1,492,063,107円
期中追加設定元本額	33,026,947円	34,821,678円
期中一部解約元本額	73,551,337円	67,770,770円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	656,030,917円	629,621,019円
北海道未来の夢創生ファンド	782,493,334円	782,493,334円
地方創生日本株ファンド	53,538,856円	46,999,662円
計	1,492,063,107円	1,459,114,015円
2．　期末日における受益権の総数	1,492,063,107口	1,459,114,015口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2022年9月27日 至　2023年3月24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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2023年3月24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	2022年9月26日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年3月24日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△12,710,699	85,989,520
合計	△12,710,699	85,989,520

（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（2022年3月25日から2022年9月26日まで、及び2022年3月25日から2023年3月24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

2022年9月26日現在	2023年3月24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）

	2022年9月26日現在	2023年3月24日現在
1口当たり純資産額	1.6287円	1.7241円
（1万口当たり純資産額）	(16,287円)	(17,241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	
九電工	10,000	3,340.00	33,400,000	
綜合警備保障	3,000	3,530.00	10,590,000	
ジャパンベストレスキューＳ	12,000	723.00	8,676,000	
ＷＤＢホールディングス	3,500	1,965.00	6,877,500	
アスクル	14,000	1,673.00	23,422,000	
パルグループＨＬＤＧＳ	8,300	2,956.00	24,534,800	
ニチレイ	11,000	2,698.00	29,678,000	
グ ン ゼ	6,000	4,535.00	27,210,000	
物語コーポレーション	18,000	2,646.00	47,628,000	
ダイワボウＨＤ	16,000	2,142.00	34,272,000	
トヨタ紡織	16,000	2,025.00	32,400,000	
マクニカホールディングス	9,000	3,610.00	32,490,000	
東急不動産ＨＤ	49,000	623.00	30,527,000	
帝国繊維	15,000	1,635.00	24,525,000	
ＢＥＥＮＯＳ	10,000	2,111.00	21,110,000	
ジェイ・エス・ビー	6,800	4,220.00	28,696,000	
セーレン	16,200	2,250.00	36,450,000	
レンゴー	14,000	845.00	11,830,000	
テイカ	10,000	1,167.00	11,670,000	
日本曹達	5,700	4,625.00	26,362,500	
トクヤマ	12,000	2,081.00	24,972,000	
東亞合成	28,000	1,188.00	33,264,000	
大阪ソーダ	6,000	4,115.00	24,690,000	
イビデン	10,000	5,030.00	50,300,000	
電算システムＨＤ	8,000	2,517.00	20,136,000	
住友ベークライト	4,000	4,875.00	19,500,000	

旭有機材	12,000	3,090.00	37,080,000	
プロトコーポレーション	10,000	1,180.00	11,800,000	
イオンファンタジー	4,000	2,610.00	10,440,000	
扶桑化学工業	6,000	3,675.00	22,050,000	
日本新薬	6,000	5,910.00	35,460,000	
ラウンドワン	45,000	501.00	22,545,000	
リゾートトラスト	13,300	2,104.00	27,983,200	
クリーク・アンド・リバー社	10,000	2,209.00	22,090,000	
大塚商会	7,000	4,490.00	31,430,000	
エフアンドエム	11,000	2,011.00	22,121,000	
オリコン	14,000	991.00	13,874,000	
フルキャストホールディングス	1,200	2,280.00	2,736,000	
コ　ニ　シ	7,000	1,816.00	12,712,000	
デクセリアルズ	15,000	2,589.00	38,835,000	
横浜ゴム	10,000	2,552.00	25,520,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,000	17,550.00	52,650,000	
大和工業	5,700	5,290.00	30,153,000	
大同特殊鋼	5,000	5,040.00	25,200,000	
山陽特殊製鋼	9,000	2,404.00	21,636,000	
栗本鉄工所	6,000	1,973.00	11,838,000	
日本製鋼所	12,000	2,437.00	29,244,000	
大紀アルミニウム	18,000	1,426.00	25,668,000	
リョービ	17,000	1,450.00	24,650,000	
高周波熱錬	29,000	673.00	19,517,000	
タ　ク　マ	24,000	1,297.00	31,128,000	
シグマクシス・ホールディンク	21,600	1,093.00	23,608,800	
芝浦機械	11,000	2,985.00	32,835,000	
オーエスジー	12,000	1,902.00	22,824,000	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	14,800	1,405.00	20,794,000	
フリュー	18,000	1,187.00	21,366,000	
日精エーエスビー	5,000	3,850.00	19,250,000	
オルガノ	7,000	3,370.00	23,590,000	
ツバキ・ナカシマ	22,000	920.00	20,240,000	
不　二　越	6,000	3,800.00	22,800,000	
ＩＤＥＣ	16,000	3,355.00	53,680,000	
マクセル	22,000	1,546.00	34,012,000	
堀場製作所	4,000	7,540.00	30,160,000	
オプテックスグループ	9,000	1,975.00	17,775,000	
太陽誘電	6,000	4,265.00	25,590,000	
ＩＨＩ	8,000	3,190.00	25,520,000	

武蔵精密工業	13,500	1,730.00	23,355,000	
太平洋工業	21,000	1,098.00	23,058,000	
豊田合成	10,000	2,158.00	21,580,000	
エフ・シー・シー	9,000	1,499.00	13,491,000	
ポピンズ	10,000	1,895.00	18,950,000	
第一興商	7,000	4,270.00	29,890,000	
アズワン	1,600	5,220.00	8,352,000	
ワークマン	5,000	5,690.00	28,450,000	
スター精密	7,000	1,737.00	12,159,000	
マニー	23,000	1,777.00	40,871,000	
ブシロード	17,000	765.00	13,005,000	
フルヤ金属	2,700	9,200.00	24,840,000	
タカラトミー	19,000	1,459.00	27,721,000	
アシックス	10,000	3,515.00	35,150,000	
エフピコ	12,000	3,135.00	37,620,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	10,000	3,185.00	31,850,000	
阪和興業	6,000	3,745.00	22,470,000	
ゴ―ルドウイン	4,500	11,610.00	52,245,000	
東祥	19,000	1,130.00	21,470,000	
青山財産ネットワークス	8,000	1,042.00	8,336,000	
鴻池運輸	9,000	1,428.00	12,852,000	
九州旅客鉄道	9,000	2,965.00	26,685,000	
上　組	12,000	2,704.00	32,448,000	
光通信	1,700	18,440.00	31,348,000	
東北電力	32,000	637.00	20,384,000	
沖縄電力	20,000	1,039.00	20,780,000	
東邦瓦斯	8,000	2,454.00	19,632,000	
東京都競馬	2,600	3,485.00	9,061,000	
ダイセキ	10,000	3,905.00	39,050,000	
合計			2,384,718,800	

(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。

「ダイワ・外債ソブリン・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

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	89,468,191	61,521,800
コール・ローン	8,414,065	2,530,438
国債証券	15,568,484,720	14,875,533,549
特殊債券	1,072,357,184	1,511,221,418
派生商品評価勘定	9,268,252	4,660,057
未収利息	147,436,659	166,747,054
前払費用	4,558,139	3,906,192
差入委託証拠金	155,685,251	151,233,573
流動資産合計	17,055,672,461	16,777,354,081
資産合計	17,055,672,461	16,777,354,081
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,257,034	13,793,531
未払解約金	8,983,040	1,339,154
流動負債合計	17,240,074	15,132,685
負債合計	17,240,074	15,132,685
純資産の部		
元本等		
元本　※1	9,446,769,758	9,091,680,225
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,591,662,629	7,670,541,171
元本等合計	17,038,432,387	16,762,221,396
純資産合計	17,038,432,387	16,762,221,396
負債純資産合計	17,055,672,461	16,777,354,081

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 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）、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。 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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1．※1　期首	2022年4月12日	2022年10月12日
期首元本額	10,089,167,480円	9,446,769,758円
期中追加設定元本額	78,381,751円	106,261,995円

期中一部解約元本額	720,779,473円	461,351,528円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,234,192,743円	1,222,015,836円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	585,760,492円	551,529,802円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	42,859,808円	43,417,814円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	130,606,724円	143,992,562円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	226,645,293円	224,525,112円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	316,647,469円	316,176,665円
６資産バランスファンド（分配型）	734,289,270円	705,577,050円
６資産バランスファンド（成長型）	101,527,334円	100,524,682円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	3,791,538,176円	3,528,842,458円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	41,315,078円	38,605,490円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	148,487,600円	140,438,043円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	663,823,323円	641,969,966円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	155,196,015円	150,238,004円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	663,609,251円	647,433,033円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	24,608,820円	23,412,851円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	475,099,550円	504,255,238円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	110,562,812円	108,725,619円
計	9,446,769,758円	9,091,680,225円

2.	期末日における受益権の総数	9,446,769,758口	9,091,680,225口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2023年4月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,827,351,598	672,979,438
特殊債券	△36,459,991	25,650,906
合計	△1,863,811,589	698,630,344

（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（2022年4月12日から2022年10月11日まで、及び2022年10月12日から2023年4月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2022年10月11日 現在				2023年4月10日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	705,132,531	－	708,614,404	△3,481,873	658,254,839	－	672,048,370	△13,793,531
イギリス・ポンド	32,380,800	－	32,323,480	57,320	－	－	－	－
ポーランド・ズロチ	296,749,731	－	293,885,064	2,864,667	276,609,839	－	282,168,370	△5,558,531
ユーロ	376,002,000	－	382,405,860	△6,403,860	381,645,000	－	389,880,000	△8,235,000
買　建	672,751,731	－	677,244,822	4,493,091	658,254,839	－	662,914,896	4,660,057
アメリカ・ドル	278,520,000	－	281,043,196	2,523,196	282,700,000	－	285,335,404	2,635,404

オーストラリア・ドル	97,482,000	－	95,628,826	△1,853,174	98,945,000	－	100,027,492	1,082,492
ノルウェー・クローネ	296,749,731	－	300,572,800	3,823,069	276,609,839	－	277,552,000	942,161
合計	1,377,884,262	－	1,385,859,226	1,011,218	1,316,509,678	－	1,334,963,266	△9,133,474

（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。

① 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。

② 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）

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1口当たり純資産額	1.8036円	1.8437円
（1万口当たり純資産額）	(18,036円)	(18,437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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	6,307,800.000	5,978,343.600	
	1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	5,149,005.120	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	19,807,400.000	16,540,565.510	
	2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,180,000.000	889,460.400	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	2,250,000.000	2,205,877.500	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 30,763,252.130 (4,079,822,497)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	3,020,000.000	2,848,101.600	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,937,856.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	657,440.000	
	0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,405,513.680	
	1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	1,024,074.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	900,000.000	966,933.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,069,530.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 11,909,448.280 (1,961,367,037)	
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	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	11,000,000.000	12,234,860.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	4,000,000.000	2,624,080.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 14,858,940.000 (1,312,935,938)	

カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 1,616,955.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,700,000.000	1,628,328.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	7,046,000.000	5,964,227.620	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	937,820.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 10,147,330.620 (996,264,920)	
スウェーデン・クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	スウェーデン・クローナ 13,630,000.000	スウェーデン・クローナ 13,470,392.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	13,527,749.500	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 26,998,142.200 (341,796,480)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,500,000.000	デンマーク・クローネ 6,948,700.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	19,772,568.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 26,721,268.000 (518,659,812)	
ノルウェー・クローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	ノルウェー・クローネ 20,000,000.000	ノルウェー・クローネ 19,923,800.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 19,923,800.000 (251,836,832)	
ポーランド・ズロチ	2.25% Poland Government Bond 20241025	ポーランド・ズロチ 3,500,000.000	ポーランド・ズロチ 3,307,780.000	

		0.75% Poland Government Bond 20250425	6,000,000.000	5,410,200.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	8,000,000.000	5,766,400.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	21,552,750.000	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 36,037,130.000 (1,113,471,639)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	725,044.850	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	6,210,400.000	6,361,312.720	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,140,615.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,400,000.000	1,102,780.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,109,510.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,172,000.000	1,120,642.960	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,203,993.560	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	5,660,000.000	5,535,366.800	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	8,528,912.800	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	896,506.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 29,724,684.690 (4,299,378,394)	
国債証券　合計				14,875,533,549 [14,875,533,549]	
特殊債券	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	
		1.25% INTL. FIN. CORP. 20310206	3,300,000.000	2,672,868.000	
		1.1% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20261216	2,500,000.000	2,282,875.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 4,955,743.000	

				(437,889,451)	
	カナダ・ドル	2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	カナダ・ドル 6,630,000.000	カナダ・ドル 6,411,939.300	
		3.55% CANADA HOUSING TRUST 20320915	3,000,000.000	3,075,030.000	
		3.65% CANADA HOUSING TRUST 20330615	1,400,000.000	1,445,318.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 10,932,287.300 (1,073,331,967)	
特殊債券　合計				1,511,221,418 [1,511,221,418]	
合計				16,386,754,967 [16,386,754,967]	

（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　5銘柄	100%	24.9%
イギリス・ポンド	国債証券　7銘柄	100%	12.0%
オーストラリア・ドル	国債証券　2銘柄 特殊債券　2銘柄	100%	10.7%
カナダ・ドル	国債証券　4銘柄 特殊債券　3銘柄	100%	12.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券　2銘柄	100%	2.1%
デンマーク・クローネ	国債証券　2銘柄	100%	3.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券　1銘柄	100%	1.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券　4銘柄	100%	6.8%
ユーロ	国債証券　10銘柄	100%	26.2%

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

「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。

「ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド」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

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	201,501,672	―
コール・ローン	554,754,447	20,775,384
国債証券	46,693,386,296	20,024,652,144
地方債証券	548,740,181	261,128,364
特殊債券	1,502,252,423	849,377,659
社債券	14,194,693,078	11,679,281,916
派生商品評価勘定	349,714,231	87,404,420
未収入金	1,679,330,307	1,845,737,377
未収利息	416,525,136	245,587,642
前払費用	10,622,918	4,658,185
差入委託証拠金	1,187,535,617	475,402,613
流動資産合計	67,339,056,306	35,494,005,704
資産合計	67,339,056,306	35,494,005,704
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	181,233,052	11,199,780
前受金	―	1,815,451,988
未払金	815,727,813	7,269,340
未払解約金	―	3,000
その他未払費用	5,940	―
流動負債合計	996,966,805	1,833,924,108
負債合計	996,966,805	1,833,924,108
純資産の部		
元本等		
元本　※1	66,891,260,440	32,911,443,684
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）　※2	△549,170,939	748,637,912
元本等合計	66,342,089,501	33,660,081,596
純資産合計	66,342,089,501	33,660,081,596
負債純資産合計	67,339,056,306	35,494,005,704

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1．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）、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。 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	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1.　※1　期首	2022年4月12日	2022年10月12日
期首元本額	65,974,683,308円	66,891,260,440円
期中追加設定元本額	9,616,798,763円	195,477,671円
期中一部解約元本額	8,700,221,631円	34,175,294,427円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ネオ・ヘッジ付債券ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	65,821,173,073円	31,821,107,071円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	867,789,329円	896,467,130円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	201,451,433円	193,025,803円
ワールド・アクティブ・ボンド・オープン（為替ヘッジあり）	846,605円	843,680円
計	66,891,260,440円	32,911,443,684円
2.　期末日における受益権の総数	66,891,260,440口	32,911,443,684口
3.　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は549,170,939円であります。	――――――

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2022年10月12日 至　2023年4月10日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、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）における債券先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2023年4月10日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,858,349,920	23,848,243
地方債証券	8,208,950	18,973,285
特殊債券	△83,689,498	△13,301,226
社債券	△304,533,111	174,619,860
合計	△2,238,363,579	204,140,162

（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（2022年6月16日から2022年10月11日まで、及び2022年6月16日から2023年4月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．債券関連

種　類	2022年10月11日 現在				2023年4月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
債券先物取引								
売　建	7,620,476,559	－	7,373,751,374	246,725,185	－	－	－	－
合計	7,620,476,559	－	7,373,751,374	246,725,185	－	－	－	－

（注）　1．時価の算定方法

債券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．債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種　類	2022年10月11日 現在				2023年4月10日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	66,040,103,644	－	66,118,347,650	△78,244,006	33,236,675,510	－	33,160,470,870	76,204,640
アメリカ・ドル	28,891,581,516	－	28,988,284,720	△96,703,204	15,823,030,850	－	15,779,939,150	43,091,700
イギリス・ポンド	2,696,142,910	－	2,708,368,700	△12,225,790	1,638,429,000	－	1,641,003,000	△2,574,000
オーストラリア・ドル	6,231,216,376	－	6,158,450,600	72,765,776	2,415,169,600	－	2,395,767,840	19,401,760
カナダ・ドル	589,157,128	－	590,632,000	△1,474,872	274,092,000	－	273,821,240	270,760
スウェーデン・クローナ	2,903,881,112	－	2,918,296,000	△14,414,888	1,785,707,360	－	1,761,933,480	23,773,880
ポーランド・ズロチ	507,370,220	－	506,133,250	1,236,970	303,601,320	－	303,891,390	△290,070
メキシコ・ペソ	2,592,209,822	－	2,601,578,700	△9,368,878	142,707,600	－	141,841,280	866,320
ユーロ	21,628,544,560	－	21,646,603,680	△18,059,120	10,853,937,780	－	10,862,273,490	△8,335,710
合計	66,040,103,644	－	66,118,347,650	△78,244,006	33,236,675,510	－	33,160,470,870	76,204,640

（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。

①　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。

②　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）

	2022年10月11日現在	2023年4月10日現在
1口当たり純資産額	0.9918円	1.0227円
（1万口当たり純資産額）	(9,918円)	(10,227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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	3,000,000.000	2,616,780.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,145,720.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	24,000,000.000	18,204,240.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	4,100,000.000	3,735,469.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	4,000,000.000	3,539,680.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	12,500,000.000	9,422,250.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	4,500,000.000	4,194,450.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	8,000,000.000	7,586,240.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	8,068,720.000	
		4.5% Mexico Government International Bond 20290422	2,000,000.000	1,979,540.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 65,493,089.000 (8,685,693,463)	

イギリス・ポンド	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	イギリス・ポンド 3,000,000.000	イギリス・ポンド 2,415,900.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,000,000.000	915,200.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	3,400,000.000	1,596,640.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 4,927,740.000 (811,549,501)	
ポーランド・ズロチ	1.25% Poland Government Bond 20301025	ポーランド・ズロチ 15,000,000.000	ポーランド・ズロチ 10,812,000.000	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 10,812,000.000 (334,068,094)	
メキシコ・ペソ	7.5% Mexican Bonos 20270603	メキシコ・ペソ 10,000,000.000	メキシコ・ペソ 9,492,900.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	10,000,000.000	9,384,000.000	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 18,876,900.000 (138,209,111)	
ユーロ	1.7% Belgium Government Bond 20500622	ユーロ 2,000,000.000	ユーロ 1,455,460.000	
	0.4% Belgium Government Bond 20400622	500,000.000	317,940.000	
	0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	500,000.000	279,000.000	
	0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	500,000.000	331,390.000	
	2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	3,500,000.000	3,629,080.000	
	1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	15,500,000.000	13,374,950.000	
	0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	11,000,000.000	8,534,790.000	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	2,000,000.000	1,950,900.000	

		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	4,000,000.000	3,678,320.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	29,000,000.000	30,023,700.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,000,000.000	1,694,280.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,500,000.000	817,155.000	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	3,000,000.000	3,431,370.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 69,518,335.000 (10,055,131,975)	
国債証券　合計				20,024,652,144 [20,024,652,144]	
地方債証券	カナダ・ドル	2.95% BRITISH COLUMBIA 20500618	カナダ・ドル 1,000,000.000	カナダ・ドル 830,530.000	
		2.05% Province of Alberta Canada 20300601	2,000,000.000	1,829,160.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 2,659,690.000 (261,128,364)	
地方債証券　合計				261,128,364 [261,128,364]	
特殊債券	イギリス・ポンド	1.625% BNG Bank NV 20250826	イギリス・ポンド 2,500,000.000	イギリス・ポンド 2,356,850.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 2,356,850.000 (388,149,627)	
	ユーロ	European Union 20310704	ユーロ 4,000,000.000	ユーロ 3,188,800.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 3,188,800.000 (461,228,032)	
特殊債券　合計				849,377,659 [849,377,659]	
社債券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

		FR 2.301% JPMorgan Chase & Co 20251015	1,000,000.000	955,810.000	
		3.875% GlaxoSmithKline Capital Inc 20280515	1,500,000.000	1,482,330.000	
		FR 7.776% STANDARD CHARTERED PLC 20251116	2,000,000.000	2,050,780.000	
		3.5% HSBC USA Inc 20240623	300,000.000	294,063.000	
		3.25% Credit Agricole SA/London 20241004	1,000,000.000	969,840.000	
		3% MetLife Inc 20250301	300,000.000	291,543.000	
		3.3% International Business Machines Corp 20260515	1,000,000.000	967,780.000	
		FR 4.254% MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 20290911	2,000,000.000	1,915,860.000	
		4.375% BNP Paribas SA 20250928	2,000,000.000	1,914,560.000	
		2.275% Exxon Mobil Corp 20260816	2,000,000.000	1,883,820.000	
		3.777% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20250302	1,000,000.000	973,720.000	
		FR 2.309% MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 20320720	3,000,000.000	2,412,960.000	
		3.1% Boeing Co/The 20260501	2,000,000.000	1,895,940.000	
		1.902% SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 20280917	2,500,000.000	2,124,050.000	
		3.04% SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 20290716	1,000,000.000	891,470.000	
		4.3% HSBC Holdings PLC 20260308	2,000,000.000	1,944,020.000	
		FR 4.583% HSBC HOLDINGS PLC 20290619	1,000,000.000	956,950.000	
		3.905% NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK 20270609	2,000,000.000	1,946,920.000	
		FR 3.75% LLOYDS BANKING GROUP PLC 20280318	1,500,000.000	1,403,985.000	
		1.65% AMAZON.COM INC 20280512	3,000,000.000	2,675,070.000	
		3.8% McDonald's Corp 20280401	1,500,000.000	1,477,830.000	
		3.3% Caterpillar Financial Services Corp 20240609	650,000.000	640,386.500	

	2.25% John Deere Capital Corp 20260914	2,000,000.000	1,867,900.000	
	3.875% CITIGROUP INC 20250326	500,000.000	485,485.000	
	FR 3.887% CITIGROUP INC 20280110	2,000,000.000	1,919,820.000	
	3.2% CITIGROUP INC 20261021	1,500,000.000	1,422,465.000	
	FR 3.593% BANK OF AMERICA CORP. 20280721	3,000,000.000	2,824,050.000	
	4.125% Wells Fargo & Co 20230815	200,000.000	199,048.000	
	4.1% Wells Fargo & Co 20260603	2,000,000.000	1,939,000.000	
	3.875% MORGAN STANLEY 20260127	1,000,000.000	979,250.000	
	FR 4.21% MORGAN STANLEY 20280420	2,000,000.000	1,948,820.000	
	4% GOLDMAN SACHS GROUP INC. 20240303	200,000.000	197,548.000	
	3.5% GOLDMAN SACHS GROUP INC. 20250401	2,000,000.000	1,943,140.000	
	FR 4.223% GOLDMAN SACHS GROUP INC. 20290501	1,000,000.000	957,870.000	
	3.875% ROYAL BANK OF CANADA 20320504	2,000,000.000	1,868,560.000	
	3.375% BPCE SA 20261202	1,000,000.000	943,730.000	
	4.8% ABN AMRO Bank NV 20260418	1,000,000.000	977,530.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 52,543,903.500 (6,968,372,482)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	5.25% Cooperatieve Rabobank UA 20270914	1,500,000.000	1,464,645.000	
	6.625% Aegon NV 20391216	200,000.000	231,764.000	
	3.75% InterContinental Hotels Group PLC 20250814	1,000,000.000	967,790.000	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 2,664,199.000 (438,766,933)	

	オーストラリア・ドル	FR 4.215% JPMorgan Chase & Co 20290522	オーストラリア・ドル 2,000,000.000	オーストラリア・ドル 1,908,060.000	
		4.6% AT&T Inc 20280919	4,300,000.000	4,316,340.000	
		FR 4.2% Credit Agricole SA 20340529	2,000,000.000	1,797,080.000	
		4.7% Societe Generale SA 20280920	1,000,000.000	930,880.000	
		4.875% Societe Generale SA 20261013	2,000,000.000	1,900,300.000	
		4% Barclays PLC 20290626	2,000,000.000	1,753,940.000	
		4.5% Verizon Communications Inc 20270817	3,500,000.000	3,523,310.000	
		2.35% VERIZON COMMUNICATIONS INC 20280323	2,000,000.000	1,799,580.000	
		3.6% Apple Inc 20260610	1,400,000.000	1,392,650.000	
		4.5% BPCE SA 20280426	3,500,000.000	3,250,590.000	
		4.2% VODAFONE GROUP 20271213	2,000,000.000	1,957,660.000	
		4.2% AusNet Services Holdings Pty Ltd 20280821	1,800,000.000	1,741,536.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 26,271,926.000 (2,321,387,381)	
	スウェーデン・クローナ	0.25% SVERIGES SAKERSTALLDA OBLIGATIONER AB 20270609	スウェーデン・クローナ 94,000,000.000	スウェーデン・クローナ 82,812,120.000	
		1.25% Lansforsakringar Hypotek AB 20250917	60,000,000.000	57,054,000.000	
	スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 139,866,120.000 (1,770,705,079)	
	ユーロ	0.95% International Business Machines Corp 20250523	ユーロ 1,000,000.000	ユーロ 954,100.000	
		1% BMW FINANCE NV 20250121	300,000.000	290,715.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 1,244,815.000 (180,050,041)	
社債券　合計				11,679,281,916	

		[11,679,281,916]	
合計		32,814,440,083 [32,814,440,083]	

（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 社債券	10銘柄 37銘柄	100%	47.7%
イギリス・ポンド	国債証券 特殊債券 社債券	3銘柄 1銘柄 3銘柄	100%	5.0%
オーストラリア・ドル	社債券	12銘柄	100%	7.1%
カナダ・ドル	地方債証券	2銘柄	100%	0.8%
スウェーデン・クローナ	社債券	2銘柄	100%	5.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券	1銘柄	100%	1.0%
メキシコ・ペソ	国債証券	2銘柄	100%	0.4%
ユーロ	国債証券 特殊債券 社債券	13銘柄 1銘柄 2銘柄	100%	32.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	801,937,888円
Ⅱ	負債総額	9,303,528円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	792,634,360円
Ⅳ	発行済数量	808,453,252口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9804円

(参考) 四国応援マザーファンド

純資産額計算書

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	1,146,031,650円
Ⅱ	負債総額	5,936,000円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,140,095,650円
Ⅳ	発行済数量	909,649,400口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2533円

(参考) 地方創生ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

純資産額計算書

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	1,142,961,110円
Ⅱ	負債総額	4,033,317円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,138,927,793円
Ⅳ	発行済数量	929,974,695口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2247円

〈参考情報〉 地方創生マザーファンド

純資産額計算書

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	2,680,214,365円
Ⅱ	負債総額	26,480,528円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,653,733,837円
Ⅳ	発行済数量	1,461,560,216口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8157円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	16,736,252,618円
Ⅱ	負債総額	80,745,480円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,655,507,138円
Ⅳ	発行済数量	9,016,281,203口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8473円

(参考) ネオ・ヘッジ付債券マザーファンド

純資産額計算書

2023年4月28日

Ⅰ	資産総額	33,997,780,694円
Ⅱ	負債総額	1,046,280,806円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,951,499,888円
Ⅳ	発行済数量	32,644,727,953口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0094円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2023年4月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　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。

②　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。

2023年4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	92	325,078
追加型株式投資信託	779	21,915,888
株式投資信託　　合計	871	22,240,966
単位型公社債投資信託	84	166,622
追加型公社債投資信託	14	1,401,574
公社債投資信託　合計	98	1,568,196
総合計	969	23,809,162

３【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2022年４月１日から2023年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,168		1,982
有価証券		486		346
前払費用		332		393
未収委託者報酬		13,811		12,525
未収収益		52		47
関係会社短期貸付金		24,900		22,100
その他		45		59
流動資産計		42,799		37,455
固定資産				
有形固定資産	※1	203	※1	196
建物		4		3
器具備品		198		193
無形固定資産		1,770		1,482
ソフトウェア		1,738		1,351
ソフトウェア仮勘定		31		131
投資その他の資産		16,617		13,824
投資有価証券		10,755		8,260
関係会社株式		3,705		3,475
出資金		177		177
長期差入保証金		1,067		1,066

繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		65		101
未払金		9,856		5,874
未払収益分配金		26		38
未払償還金		12		12
未払手数料		4,917		4,525
その他未払金	※2	4,900	※2	1,297
未払費用		4,246		3,987
未払法人税等		980		560
未払消費税等		1,016		327
賞与引当金		866		692
その他		2		2
流動負債計		17,033		11,545
固定負債				
退職給付引当金		2,399		2,276
役員退職慰労引当金		13		51
その他		1		0
固定負債計		2,415		2,329
負債合計		19,449		13,874
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495
利益剰余金				
利益準備金		374		374
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		13,925		11,505

利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692
福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95

租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	327	286
有価証券償還益	40	150
その他	264	171
営業外収益計	631	608
営業外費用		
投資有価証券売却損	59	244
有価証券償還損	0	2
その他	34	31
営業外費用計	93	277
経常利益	19,089	15,642
特別損失		
関係会社整理損失	-	229
投資有価証券評価損	331	257
特別損失計	331	486
税引前当期純利益	18,757	15,155
法人税、住民税及び事業税	5,950	4,589
法人税等調整額	69	248
法人税等合計	6,019	4,838
当期純利益	12,738	10,317

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年４月１日 至　2022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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

当事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

	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	971	971	41,941
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 12,737
当期純利益	-	-	10,317
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

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　　15～18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．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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-３項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（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 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

※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 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
未払金	4,694百万円	1,178百万円

３　保証債務

前事業年度（2022年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2023年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,112百万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　2021年４月１日　至　2022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
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

（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

2022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。

①剰余金の配当の総額　12,737百万円
②配当の原資　利益剰余金
③１株当たり配当額　4,883円
④基準日　2022年３月31日

⑤効力発生日　　2022年６月24日

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023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
2022年６月23日定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年３月31日	2022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

2023年６月26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。

①剰余金の配当の総額　　10,316百万円
②配当の原資　　利益剰余金
③１株当たり配当額　　3,955円
④基準日　　2023年３月31日
⑤効力発生日　　2023年６月27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グループ通算制度における通算親法人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関係す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

①市場リスクの管理

（ｉ）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。

（ii）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。

②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。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（2022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
有価証券及び投資有価証券	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

当事業年度（2023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
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	－	7,939
資産合計	57	7,882	－	7,939

（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

有価証券及び投資有価証券

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。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。

（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	1,677	1,448
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（2022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。

当事業年度（2023年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,448百万円）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（2022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	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

（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（2023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	57	55	1
（２）その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	△392
小計	2,798	3,190	△392
合計	7,939	7,168	△771

（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　2021年４月１日　至　2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023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	2,359	296	244

合計	2,359	296	244

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331百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について257百万円、関係会社株式について229百万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おります。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	△ 303	△ 322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

(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　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,399百万円	2,276百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
勤務費用	152百万円	150百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

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189百万円、当事業年度184百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	－	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	△ 356	△ 459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 562	△ 356
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 722	△ 515
繰延税金資産の純額	885	824

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（2022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（2023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。

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理
当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021年８月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）
（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
　当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が69,845百万円、その他559百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報
（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３） 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
　重要性が乏しいため記載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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023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　2021年４月１日　至　2022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	㈱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）	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023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	㈱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）	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 0

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　2021年４月１日　至　2022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）	1,900	―	―

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　2022年４月１日　至　2023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）	2,112	―	―

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　2021年４月１日　至　2022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3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	1,065	未払費用	91

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）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4）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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023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3）	13,072 1,062	未払手数料 長期差入保証金	2,663 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	883	未払費用	81

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) 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4) 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。

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　2021年４月１日 至　2022年３月31日）		当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	
１株当たり純資産額	16,078.50円	１株当たり純資産額	14,983.42円
１株当たり当期純利益	4,883.43円	１株当たり当期純利益	3,955.35円

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

(注２)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　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
当期純利益（百万円）	12,738	10,317
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

① 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。)。

② 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。)。

③ 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④⑤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。

④ 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。

⑤ 上記③④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】

	①　名　称	②　資本金の額 (2022年03月末日現在)	③　事業の内容	④　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）	
	四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	野村證券株式会社	10,000百万円	（注1）	
	株式会社阿波銀行	23,452百万円	（注3）	
	株式会社伊予銀行	20,948百万円	（注3）	
	株式会社百十四銀行	37,322百万円	（注3）	

（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。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充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）を行ないます。

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
・使用開始日を記載することがあります。
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
・次の事項を記載することがあります。
①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
・ファンドの形態等を記載することがあります。
・図案を採用することがあります。
・ファンドの管理番号等を記載することがあります。
・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。
(5) 交付目論見書に「投資家のみなさまへ」として、以下の内容を記載することがあります。

投資家のみなさまへ

私どもは、四国を中心に活躍する企業をはじめ、地方創生に資する企業と海外の債券に投資する、ファンドを提供させていただいております。

投資を通じて四国を含む地域の活性化を応援し地域の成長を享受しながら、海外の債券を組み合わせて投資することで安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

お手持ちの資金を預貯金のほか、さまざまな資産に投資することをお考えのお客さまや、将来に備えた資産づくりのために積立投資などをお考えのお客さまの運用商品のひとつとしてふさわしいと考えております。

長期投資をお考えのお客さまの資産運用、資産形成の一助となれば幸いです。

独立監査人の監査報告書

2023年５月26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

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2022年４月１日から2023年３月31日までの第64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2023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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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．　上記の監査報告書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

2023年6月2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	秋山　範之
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」に掲げられている四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）の2022年10月12日から2023年4月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）の2023年4月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。