【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年8月3日提出
【計算期間】	第35特定期間 （自　2022年11月11日　至　2023年5月10日）
【ファンド名】	安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、内外の公社債、不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざし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〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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。

2. インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、「1．安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

3．成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、「1．安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

（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。

上記1.～3. は、「ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ（愛称：ミルフィーユ）（奇数月分配型）」を構成します。

※各ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

ファンドの名称	略称
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	安定重視ポートフォリオ
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	インカム重視ポートフォリオ
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	成長重視ポートフォリオ

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

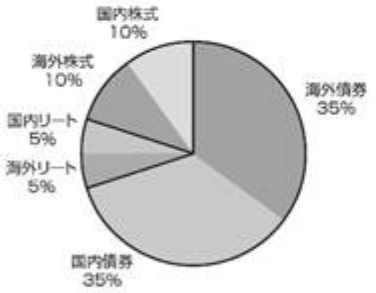
1 内外の債券、リートおよび株式に投資します(注)。

(注)「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」は、「わが国の債券」に投資しません。

資産配分のイメージ

各ファンド（安定重視ポートフォリオ／インカム重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ）における各資産の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処とします。

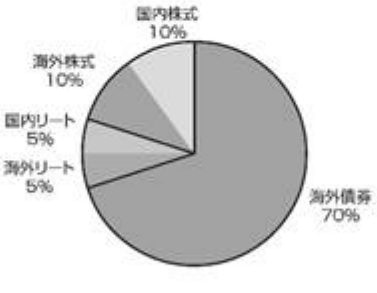
安定重視ポートフォリオ



＜標準組入比率＞

	海外	国内	合計
債券	35%	35%	70%
リート	5%	5%	10%
株式	10%	10%	20%
合計	50%	50%	100%

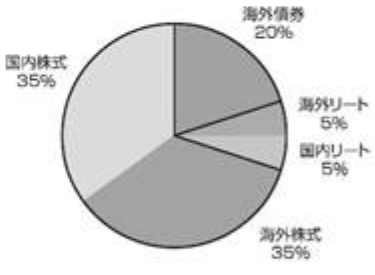
インカム重視ポートフォリオ



＜標準組入比率＞

	海外	国内	合計
債券	70%	―	70%
リート	5%	5%	10%
株式	10%	10%	20%
合計	85%	15%	100%

成長重視ポートフォリオ



＜標準組入比率＞

	海外	国内	合計
債券	20%	―	20%
リート	5%	5%	10%
株式	35%	35%	70%
合計	60%	40%	100%

※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

（注1）「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「ダイワ日本国債マザーファンド」を除きます。
（注2）「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「わが国の国債」を除きます。

2 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

※「ソブリン債等」とは、国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債などをいいます。

●ドル通貨圏（米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等）、欧州通貨圏（ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等）の2つの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。
●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。

ポートフォリオのイメージ

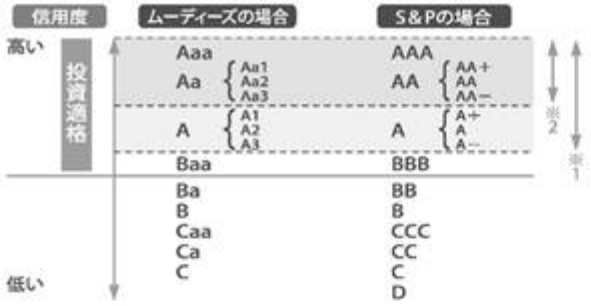
ドル通貨圏：50%程度　欧州通貨圏：50%程度

※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
※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。

（注）上記はイメージであり、実際の投資割合が上記のとおりとなるとは限りません。

●国債の格付けは、取得時においてA格相当以上※1、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上※2とすることを基本とします。

債券の格付けについて



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）やS&Pグローバル・レーティング（S&P）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。

※1　ムーディーズでA3以上またはS&PでA−以上
※2　ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上

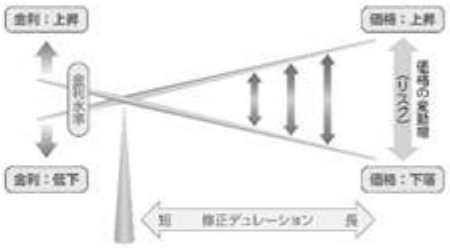
●ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

●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。

金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ）

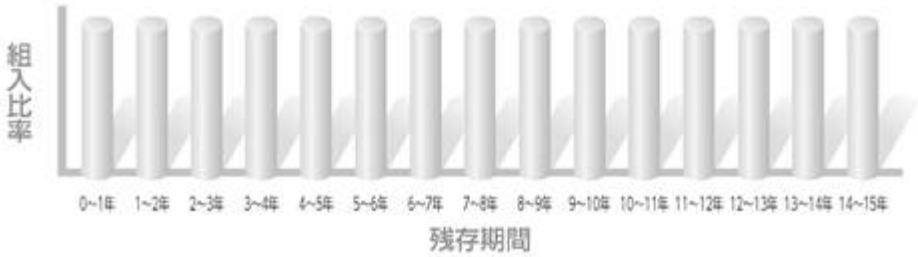


●金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

3　わが国の国債への投資にあたっては、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

●原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

海外のリートの投資対象地域 （イメージ）

投資対象銘柄の業種 （イメージ）

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

●北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成 （イメージ）

投資対象のイメージ

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

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

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

※ハイブリッド優先証券とは…
- 株式と債券の両方の性質を併せ持った証券です。
- 弁済順位は、株式と債券の中間の位置付けとなります。

〈 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて 〉

- 米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- 優先リートを含むハイブリッド証券などのインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- リート運用では最大級の資産規模。
- ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- 所在地：アメリカ合衆国　ニューヨーク州　ニューヨーク

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

〈 アムンディ・アイルランド・リミテッドについて 〉

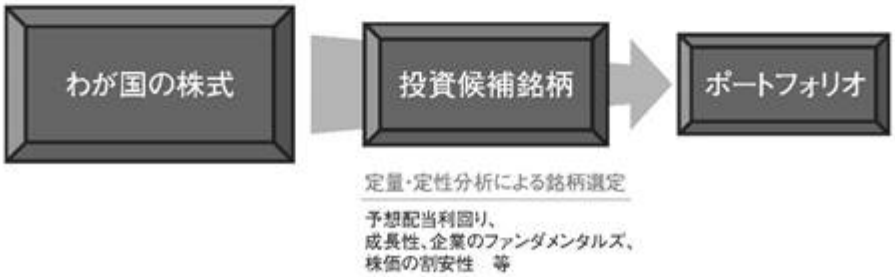
アムンディ・アイルランド・リミテッドは、運用資産額で欧州および世界でトップクラスに入るフランスの資産運用会社アムンディ・グループの主要運用拠点のひとつで、アイルランド（ダブリン市）に所在します。

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

投資対象のイメージ

※配当利回り：株式投資を行なう際に用いられる株式の投資価値を測る指標のひとつです。個別銘柄の配当利回りから株価の割安度の測定や、株式市場全体の配当利回りと市場金利を比較して、株価水準の妥当性の測定などを行なうことができます。
配当利回り（%）＝（1株当たり年間配当金 ÷ 株価）×100

銘柄選定プロセス



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

- 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1. ～6. の運用が行なわれないことがあります。

7 毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11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。

〈分配方針〉

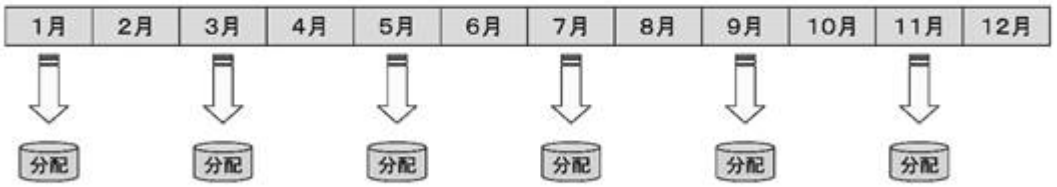
[安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ]

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。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。

[インカム重視ポートフォリオ]

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、配当等収益等を中心に継続した分配を行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配を行ないます。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。

収益分配のイメージ



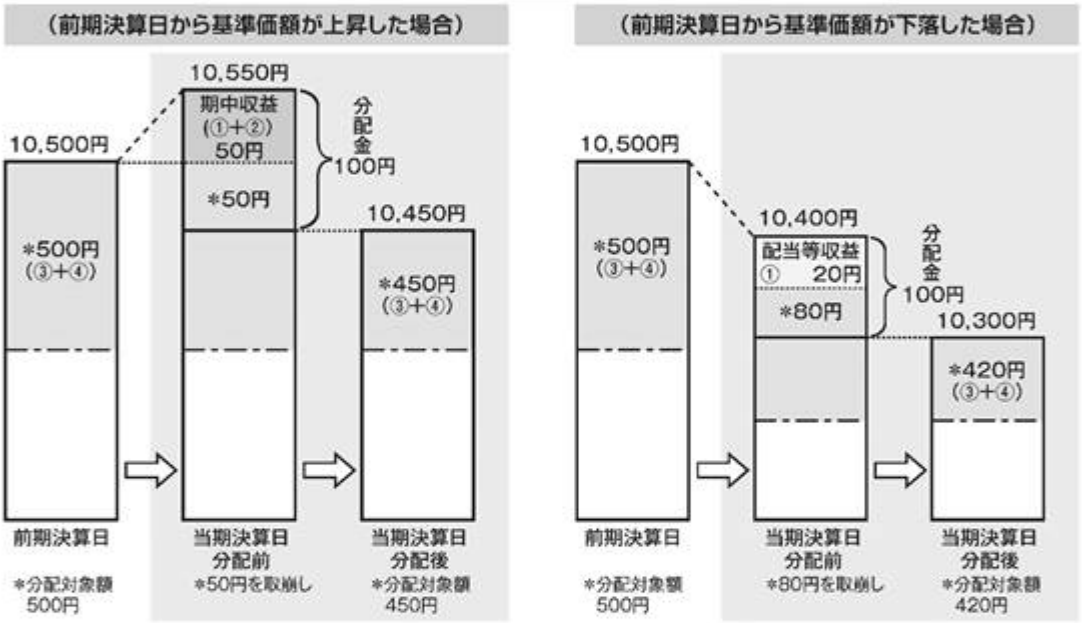
- 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

［収益分配金に関する留意事項］

●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

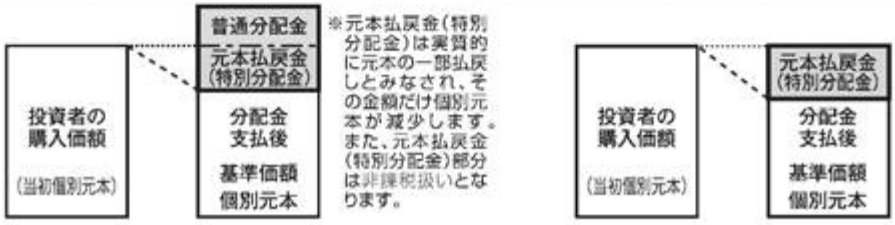


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）　（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金） … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

(2)【ファンドの沿革】

2005年11月14日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金(※5)

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※5)

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金(※5)

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	内外の公社債、不動産投資信託証券および株式　など ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。 ・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）

（注1）「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。
（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（※3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（※4）。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
※4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
※5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社の概況（2023年5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

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券（安定重視ポートフォリオのみ）

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

② 投資態度

＜安定重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

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35%
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の35%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%

ハ．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

＜インカム重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

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70%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%

ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

＜成長重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

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20%

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の35%

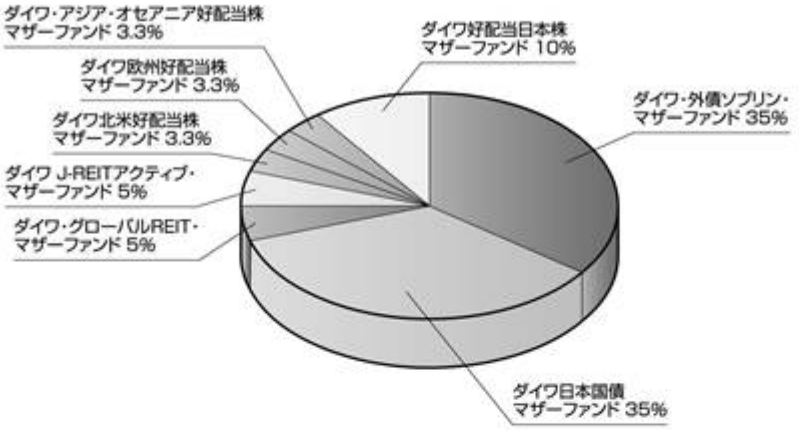
ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

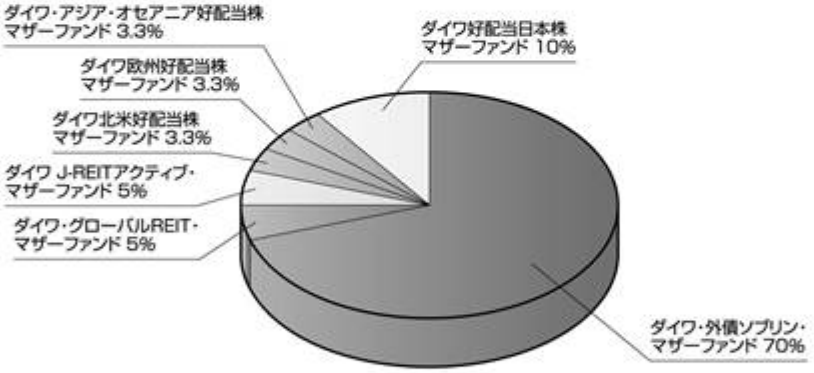
各ファンド(安定重視ポートフォリオ／インカム重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ)における各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

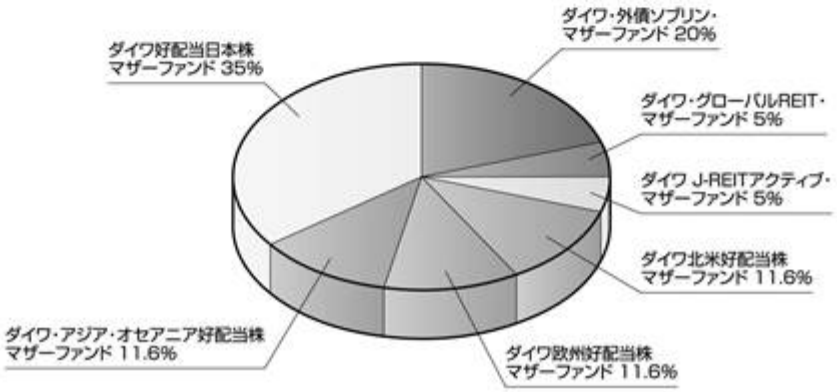
〈安定重視ポートフォリオ〉



〈インカム重視ポートフォリオ〉



〈成長重視ポートフォリオ〉



(2)【投資対象】

＜各ファンド共通＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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。）

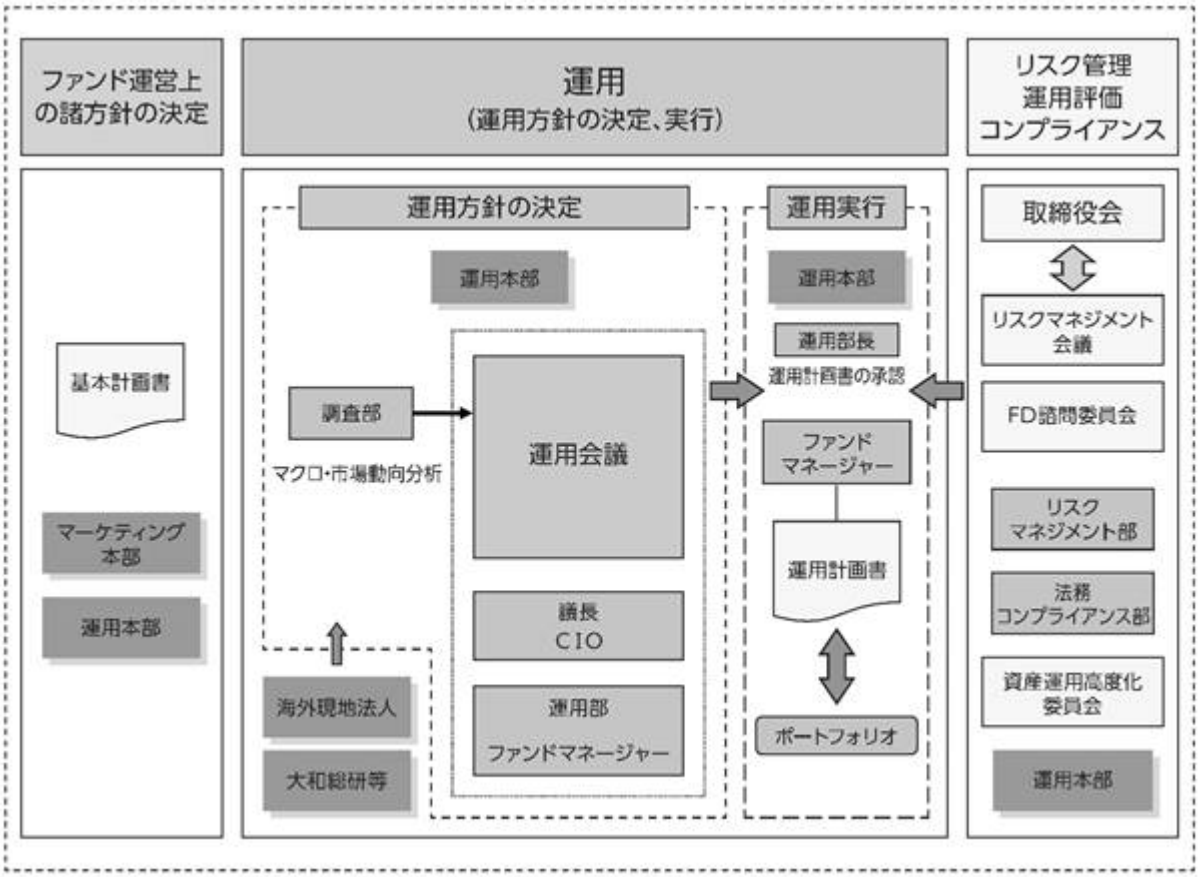
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(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。

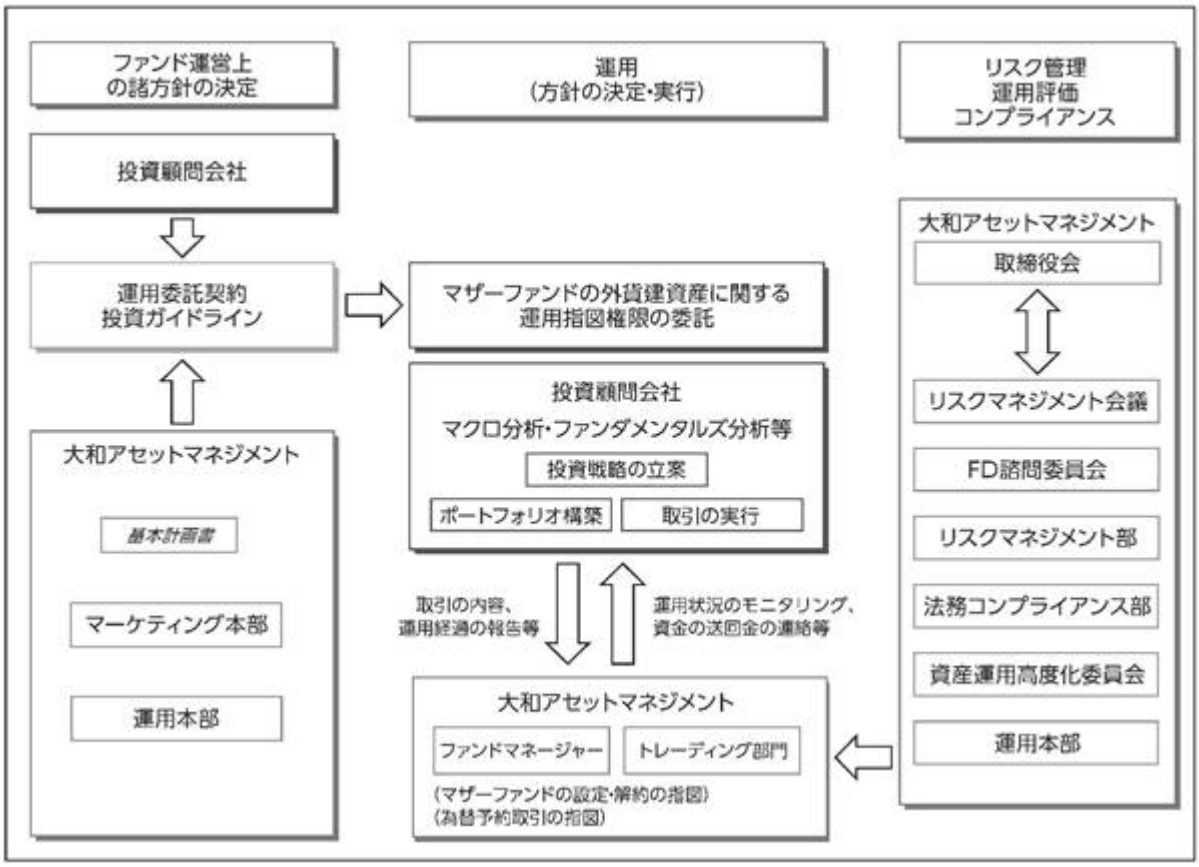
ハ．資産運用高度化委員会

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。

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



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も行なっています。

ニ．リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

（前④に同じ。）

※　上記の運用体制は2023年5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】

＜安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ＞

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、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。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。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

＜インカム重視ポートフォリオ＞

① （安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオと同規定）

② 原則として、配当等収益等を中心に継続した分配を行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配を行ないます。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。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

③ （安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオと同規定）

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤ 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。

⑥ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．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。

ロ．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。

ａ．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

ｂ．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。）。

ｃ．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。

ｄ．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。

ｅ．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の国債先物取引等を利用することがあります。

ハ．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。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

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

10．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

12．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2．ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。

ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

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.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（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、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2.～16.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

③ （ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① （ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

② （ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

イ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ.と同規定）

⑤ スワップ取引

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

ロ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

ホ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

⑥ 金利先渡取引

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

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

ハ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

3．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

(3) 主な投資制限

①　株式への直接投資は、行ないません。
②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

①　委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

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

②　前①の規定にかかわらず、前①により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

(3) 主な投資制限

①　株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

④　外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤　先物取引

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

1．先物取引の売建の指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ．主として、北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ロ．銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。

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

ニ．株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ホ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

(2) 投資対象

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

なお、前1.の証券または証書、前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券、前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前14.の証券および前15.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞
＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

①　（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

1.～11.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

③　（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

＜各ファンド共通＞

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

③　先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならび

に前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

④　スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

(4) 運用指図権限の委託

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

①　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

②　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

①　委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

②　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

該当事項はありません。

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．株券または新株引受権証書

2.～10.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12.～20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

③ （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

③　先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

④　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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。

②　ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

組入ハイブリッド優先証券の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③　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。

④　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。

・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

⑤　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

⑥　その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

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

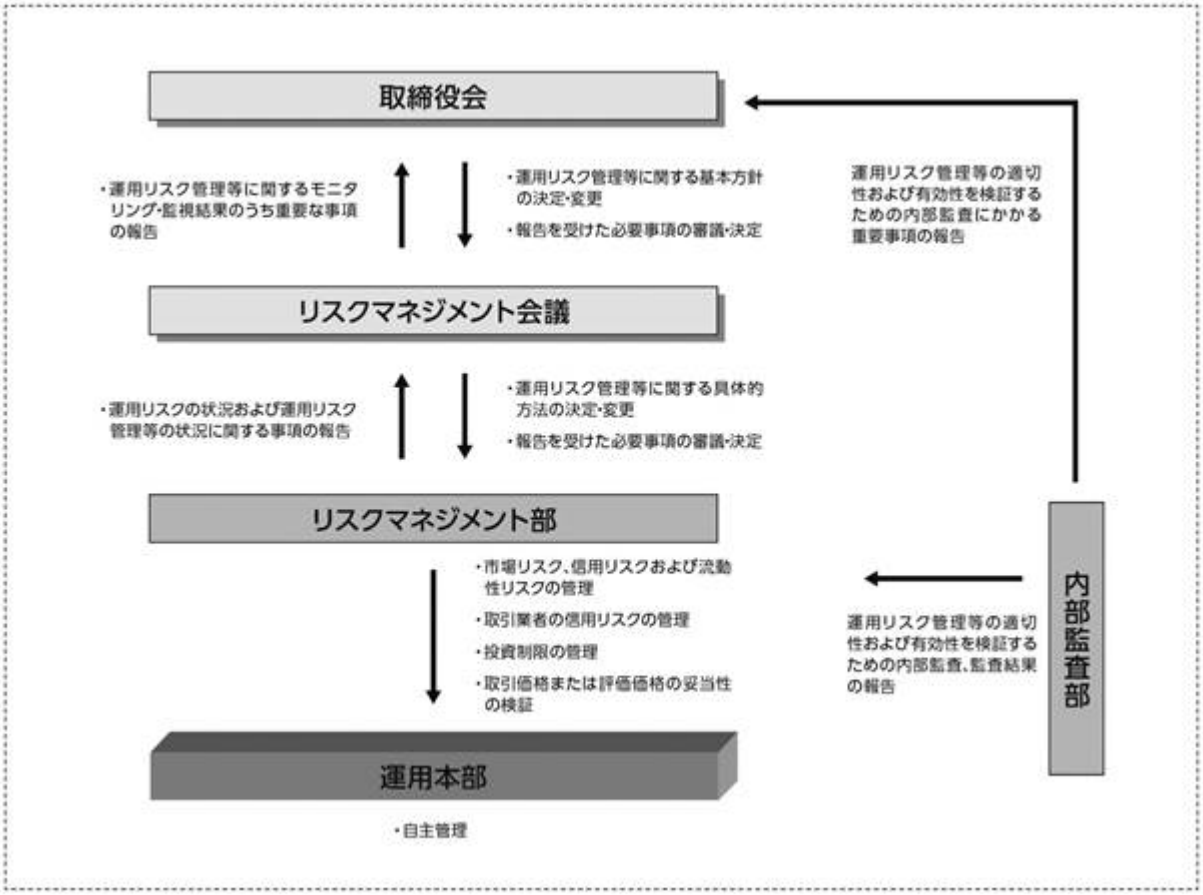
※　流動性リスクに関する事項

・　当ファンドは、大量の解約が発生し短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。**

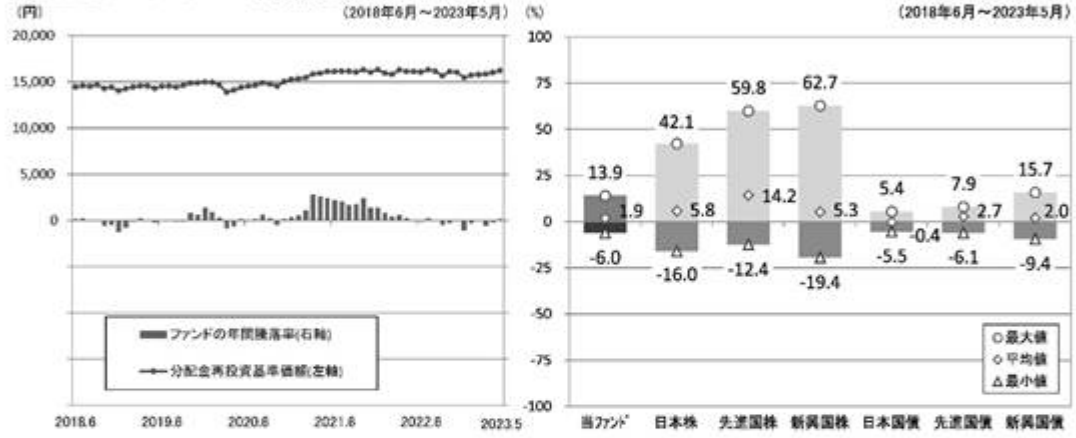
参　考　情　報

●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。

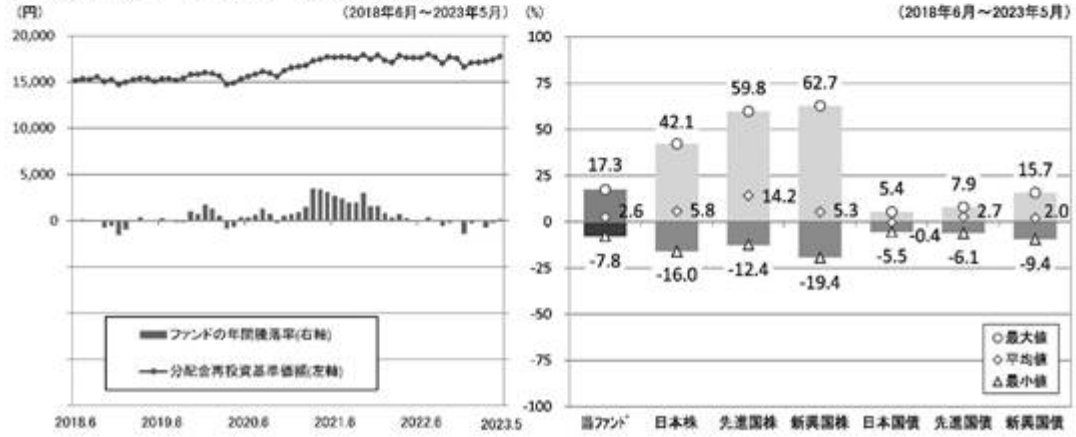
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

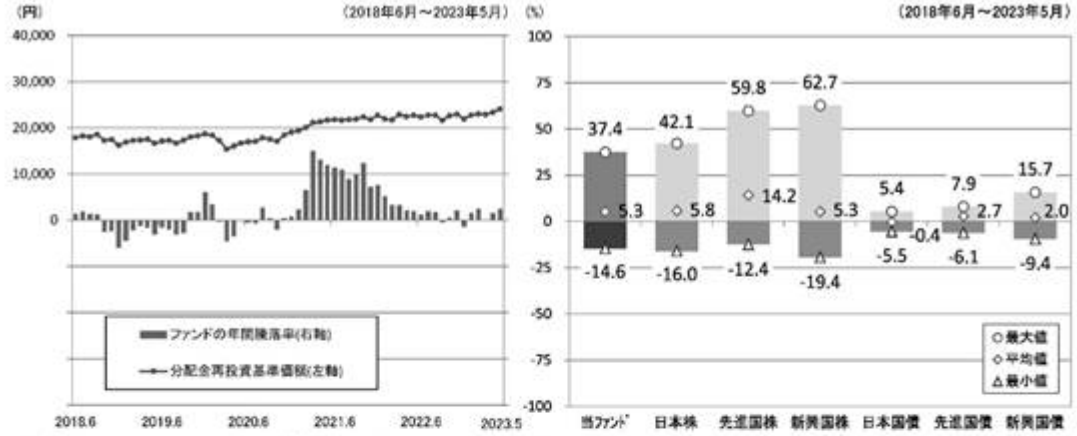
［安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



［インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



［成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



※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、2.2%（税抜2.0%）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次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され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。

安定重視ポートフォリオ	年率1.32%（税抜1.20%）
インカム重視ポートフォリオ	年率1.4025%（税抜1.275%）
成長重視ポートフォリオ	年率1.485%（税抜1.35%）

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。

イ．安定重視ポートフォリオ

	委託会社	販売会社（各販売会社の取扱純資産総額に応じて）	受託会社
100億円以下の部分	年率1.20%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.60%（税抜）	年率0.05%（税抜）
100億円超200億円以下の部分		年率0.65%（税抜）	
200億円超500億円以下の部分		年率0.70%（税抜）	
500億円超1,000億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.80%（税抜）	

ロ．インカム重視ポートフォリオ

	委託会社	販売会社（各販売会社の取扱純資産総額に応じて）	受託会社
100億円以下の部分	年率1.275%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.65%（税抜）	年率0.05%（税抜）
100億円超200億円以下の部分		年率0.70%（税抜）	
200億円超500億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
500億円超1,000億円以下の部分		年率0.80%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.85%（税抜）	

ハ．成長重視ポートフォリオ

	委託会社	販売会社（各販売会社の取扱純資産総額に応じて）	受託会社

100億円以下の部分	年率1.35%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.70%（税抜）	年率0.05%（税抜）
100億円超200億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
200億円超500億円以下の部分		年率0.80%（税抜）	
500億円超1,000億円以下の部分		年率0.85%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.90%（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　委託会社は、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

イ．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に年率0.57%以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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5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。

（注）2024年以降、NISAの抜本的拡充・恒久化が図られ、新しいNISAが導入されます。新しいNISAの適用対象ファンドにつきましては、委託会社のホームページ〔 https://www.daiwa-am.co.jp/ 〕に掲載しますので、ご確認ください。

※当ファンドにおける上記の「少額投資非課税制度」に関する取扱いは、2023年12月末購入分までとなります。

5【運用状況】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1)【投資状況】(2023年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		768,180,083	99.20
	内 日本	768,180,083	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,212,722	0.80
純資産総額		774,392,805	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5月31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	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	143,453,129	1.8718 268,515,566	1.8804 269,749,263	34.83
2	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	212,550,713	1.2438 264,390,865	1.2439 264,391,831	34.14
3	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	19,566,691	3.9947 78,163,060	4.0562 79,366,412	10.25
4	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,178,226	3.4235 38,268,656	3.4647 38,729,199	5.00
5	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,023,195	3.5024 38,607,638	3.5025 38,608,740	4.99
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,337,594	4.6052 24,580,687	4.8637 25,960,455	3.35

7	ダイワ･アジア･オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,239,994	2.9881 24,621,926	3.1277 25,772,229	3.33
8	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,162,732	2.5432 25,845,860	2.5192 25,601,954	3.31

(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	99.20%
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16特定期間末 (2013年11月11日)	1,828,381,467	1,838,763,868	0.8805	0.8855
第17特定期間末 (2014年5月12日)	1,599,035,793	1,607,888,426	0.9031	0.9081
第18特定期間末 (2014年11月10日)	1,564,939,411	1,573,080,464	0.9611	0.9661
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,466,139,398	1,473,605,263	0.9819	0.9869
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,332,286,357	1,339,328,742	0.9459	0.9509

第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,275,810,635	1,280,763,009	0.9017	0.9052
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,158,313,348	1,162,998,429	0.8653	0.8688
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,123,093,842	1,126,188,676	0.9072	0.9097
第24特定期間末 (2017年11月10日)	1,034,788,125	1,036,447,975	0.9351	0.9366
第25特定期間末 (2018年5月10日)	967,647,840	969,234,113	0.9150	0.9165
第26特定期間末 (2018年11月12日)	893,566,366	895,052,636	0.9018	0.9033
第27特定期間末 (2019年5月10日)	872,820,093	874,284,036	0.8943	0.8958
第28特定期間末 (2019年11月11日)	832,937,076	834,300,311	0.9165	0.9180
第29特定期間末 (2020年5月11日)	725,646,190	726,897,697	0.8697	0.8712
第30特定期間末 (2020年11月10日)	698,324,933	699,468,589	0.9159	0.9174
第31特定期間末 (2021年5月10日)	714,859,638	715,954,396	0.9795	0.9810
第32特定期間末 (2021年11月10日)	695,561,498	696,618,226	0.9873	0.9888
第33特定期間末 (2022年5月10日)	702,489,038	703,588,144	0.9587	0.9602
2022年5月末日	705,753,227	－	0.9754	－
6月末日	703,571,939	－	0.9709	－
7月末日	713,437,240	－	0.9848	－
8月末日	701,121,928	－	0.9755	－
9月末日	693,348,106	－	0.9448	－
10月末日	712,215,466	－	0.9702	－
第34特定期間末 (2022年11月10日)	700,073,137	701,163,612	0.9630	0.9645
11月末日	708,364,501	－	0.9652	－
12月末日	704,237,060	－	0.9296	－
2023年1月末日	721,702,206	－	0.9442	－
2月末日	742,082,008	－	0.9488	－
3月末日	752,939,256	－	0.9507	－

4月末日	764,265,288	－	0.9605	－
第35特定期間末 (2023年5月10日)	769,000,198	770,194,064	0.9662	0.9677
5月末日	774,392,805	－	0.9720	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0150
第19特定期間	0.0150
第20特定期間	0.0150
第21特定期間	0.0135
第22特定期間	0.0105
第23特定期間	0.0075
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045
第34特定期間	0.0045
第35特定期間	0.0045

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第16特定期間	△2.6
第17特定期間	4.3
第18特定期間	8.1
第19特定期間	3.7
第20特定期間	△2.1
第21特定期間	△3.2
第22特定期間	△2.9
第23特定期間	5.7
第24特定期間	3.6

第25特定期間	△1.7
第26特定期間	△1.0
第27特定期間	△0.3
第28特定期間	3.0
第29特定期間	△4.6
第30特定期間	5.8
第31特定期間	7.4
第32特定期間	1.3
第33特定期間	△2.4
第34特定期間	0.9
第35特定期間	0.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第16特定期間	67,499,016	322,616,895
第17特定期間	20,512,498	326,466,069
第18特定期間	36,554,030	178,870,138
第19特定期間	30,337,306	165,374,860
第20特定期間	28,106,161	112,802,115
第21特定期間	74,111,919	67,624,842
第22特定期間	25,510,906	101,880,470
第23特定期間	16,442,452	117,103,386
第24特定期間	50,120,711	181,487,643
第25特定期間	19,575,536	68,626,578
第26特定期間	31,692,198	98,360,995
第27特定期間	48,286,397	63,170,843
第28特定期間	8,617,791	75,756,294
第29特定期間	11,410,328	85,896,293
第30特定期間	10,881,980	82,782,003
第31特定期間	61,263,599	93,862,473
第32特定期間	30,258,792	55,612,312
第33特定期間	49,921,905	21,669,644
第34特定期間	39,944,612	45,699,082
第35特定期間	107,674,511	38,747,198

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		14,491,186,980	86.33
	内 ユーロ	4,212,776,366	25.10
	内 ノルウェー	248,707,500	1.48
	内 スウェーデン	347,093,822	2.07
	内 デンマーク	533,140,347	3.18
	内 イギリス	1,928,350,869	11.49
	内 ポーランド	1,136,603,121	6.77
	内 カナダ	1,002,287,471	5.97
	内 アメリカ	4,075,339,350	24.28
	内 オーストラリア	1,006,888,134	6.00
特殊債券		1,887,967,636	11.25
	内 ユーロ	148,317,541	0.88
	内 カナダ	1,058,965,230	6.31
	内 オーストラリア	680,684,865	4.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		407,123,552	2.43
純資産総額		16,786,278,168	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）		678,179,752	4.04
	内 日本	678,179,752	4.04
為替予約取引（売建）		680,167,162	△4.05
	内 日本	680,167,162	△4.05

(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5月31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 2,311,874,841	81.98 2,269,821,626	0.875000 2030/11/15	13.52

2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	93.35 1,279,678,076	92.62 1,269,698,904	1.400000 2028/04/30	7.56
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,210,400	102.43 954,451,360	99.12 923,673,727	3.250000 2045/05/25	5.50
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,307,800	94.77 835,593,084	93.55 824,810,613	2.250000 2027/08/15	4.91
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,660,000	97.79 830,526,434	97.04 824,106,283	1.950000 2026/04/30	4.91
6	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	86.21 712,762,374	86.69 716,730,846	2.750000 2028/04/25	4.27
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	66.99 719,676,445	64.08 688,415,124	1.125000 2040/08/15	4.10
8	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,900,000	111.22 698,925,275	106.75 670,855,406	4.500000 2033/04/21	4.00
9	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	6,230,000	96.71 618,717,036	95.34 610,003,522	2.250000 2025/12/15	3.63
10	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	7,046,000	84.64 612,466,534	81.67 590,955,281	0.500000 2030/12/01	3.52
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	91.80 510,276,208	87.64 487,143,479	1.625000 2028/10/22	2.90
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,020,000	94.30 494,686,766	91.58 480,382,457	1.500000 2026/07/22	2.86
13	INTL. FIN. CORP.	オーストラリア	特殊債券	5,600,000	80.37 409,916,543	79.02 403,021,178	1.250000 2031/02/06	2.40
14	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	97.88 398,417,245	97.41 396,504,204	1.750000 2025/11/15	2.36
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	77.70 417,813,671	73.07 392,897,017	0.250000 2031/07/31	2.34
16	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,100,000	64.12 356,253,272	60.48 336,032,727	1.750000 2051/06/21	2.00
17	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	92.31 330,687,193	91.02 326,073,120	1.100000 2029/05/15	1.94
18	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	108.18 316,510,880	105.06 307,405,853	3.750000 2045/06/22	1.83
19	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	3,000,000	102.50 315,774,830	99.15 305,454,485	3.550000 2032/09/15	1.82
20	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	99.61 249,047,500	99.48 248,707,500	3.000000 2024/03/14	1.48
21	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	2,500,000	91.31 207,901,426	90.05 205,034,998	1.100000 2026/12/16	1.22

22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,000,000	72.08 190,698,307	72.60 192,074,044	1.250000 2030/10/25	1.14
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,000,000	90.17 178,918,560	91.01 180,595,239	0.750000 2025/04/25	1.08
24	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	98.82 173,363,954	99.12 173,874,420	1.500000 2023/11/13	1.04
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	95.06 174,102,136	94.58 173,219,400	1.000000 2026/11/12	1.03
26	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	106.95 185,766,665	94.95 164,920,391	4.250000 2046/12/07	0.98
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,400,000	78.77 165,461,111	77.92 163,692,439	－ 2032/05/25	0.98
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,100,000	54.31 171,137,874	51.65 162,753,489	0.750000 2053/05/25	0.97
29	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,700,000	95.78 167,213,002	91.34 159,456,723	2.750000 2048/12/01	0.95
30	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	107.79 166,045,108	103.41 159,301,456	3.500000 2045/12/01	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	86.33%
特殊債券	11.25%
合計	97.57%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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6月	買建	22,000,000	280,329,181	274,120,000	1.63%

		米ドル買/円売 2023年6月	買建	2,152,116	301,680,000	299,380,856	1.78%
		豪ドル買/円売 2023年6月	買建	1,153,614	105,588,000	104,678,896	0.62%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2023年6月	売建	8,413,064	280,329,181	276,247,162	△1.65%
		ユーロ売/円買 2023年6月	売建	2,700,000	407,268,000	403,920,000	△2.41%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		107,223,483,240	99.20
	内 日本	107,223,483,240	99.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		860,982,995	0.80
純資産総額		108,084,466,235	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5月31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	12 30年国債	日本	国債証券	4,100,000,000	114.96 4,713,401,000	116.36 4,770,842,000	2.100000 2033/09/20	4.41
2	16 30年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	119.64 4,665,960,000	121.46 4,737,057,000	2.500000 2034/09/20	4.38
3	27 30年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	121.48 4,616,506,000	123.96 4,710,784,000	2.500000 2037/09/20	4.36
4	20 30年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	120.24 4,569,120,000	122.40 4,651,238,000	2.500000 2035/09/20	4.30

5	140 20年国債	日本	国債証券	4,100,000,000	110.55 4,532,550,000	112.01 4,592,533,000	1.700000 2032/09/20	4.25
6	121 20年国債	日本	国債証券	4,100,000,000	110.91 4,547,462,000	111.95 4,590,196,000	1.900000 2030/09/20	4.25
7	24 30年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	120.89 4,352,112,000	123.25 4,437,252,000	2.500000 2036/09/20	4.11
8	130 20年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	110.89 4,324,710,000	112.01 4,368,663,000	1.800000 2031/09/20	4.04
9	1 30年国債	日本	国債証券	3,550,000,000	116.03 4,119,136,000	116.51 4,136,211,500	2.800000 2029/09/20	3.83
10	63 20年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	100.53 3,920,670,000	100.10 3,903,978,000	1.800000 2023/06/20	3.61
11	94 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	107.98 3,887,424,000	108.02 3,888,756,000	2.100000 2027/03/20	3.60
12	101 20年国債	日本	国債証券	3,460,000,000	110.93 3,838,247,200	111.14 3,845,651,600	2.400000 2028/03/20	3.56
13	70 20年国債	日本	国債証券	3,638,000,000	103.15 3,752,692,000	102.64 3,734,370,620	2.400000 2024/06/20	3.46
14	80 20年国債	日本	国債証券	3,573,000,000	104.85 3,746,361,960	104.45 3,732,320,070	2.100000 2025/06/20	3.45
15	75 20年国債	日本	国債証券	3,374,000,000	104.33 3,520,262,900	103.92 3,506,260,800	2.100000 2025/03/20	3.24
16	102 20年国債	日本	国債証券	3,100,000,000	111.35 3,452,129,000	111.61 3,460,127,000	2.400000 2028/06/20	3.20
17	86 20年国債	日本	国債証券	3,200,000,000	106.92 3,421,440,000	106.60 3,411,328,000	2.300000 2026/03/20	3.16
18	95 20年国債	日本	国債証券	3,105,000,000	109.24 3,391,902,000	109.29 3,393,671,850	2.300000 2027/06/20	3.14
19	110 20年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	110.83 3,325,140,000	111.34 3,340,200,000	2.100000 2029/03/20	3.09
20	88 20年国債	日本	国債証券	3,060,000,000	107.43 3,287,508,000	107.18 3,279,799,800	2.300000 2026/06/20	3.03
21	68 20年国債	日本	国債証券	3,025,000,000	102.33 3,095,482,500	101.87 3,081,749,000	2.200000 2024/03/20	2.85
22	116 20年国債	日本	国債証券	2,700,000,000	113.17 3,055,794,000	113.49 3,064,311,000	2.200000 2030/03/20	2.84
23	134 20年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	111.31 2,671,560,000	112.52 2,700,528,000	1.800000 2032/03/20	2.50
24	125 20年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	113.67 2,614,548,000	114.69 2,638,077,000	2.200000 2031/03/20	2.44

25	28　30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	124.07 2,481,560,000	124.22 2,484,440,000	2.500000 2038/03/20	2.30
26	145　20年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	110.85 2,438,700,000	112.23 2,469,214,000	1.700000 2033/06/20	2.28
27	26　30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	119.86 2,397,200,000	122.31 2,446,320,000	2.400000 2037/03/20	2.26
28	143　20年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	112.07 2,465,570,000	111.15 2,445,498,000	1.600000 2033/03/20	2.26
29	19　30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	117.74 2,354,800,000	119.84 2,396,940,000	2.300000 2035/06/20	2.22
30	15　30年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	119.49 2,270,310,000	121.20 2,302,800,000	2.500000 2034/06/20	2.13

(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	99.20%
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。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		86,189,307,141	98.27
	内　香港	2,908,935,303	3.32
	内　シンガポール	6,741,449,970	7.69

	内 イギリス	9,705,481,971	11.07
	内 オランダ	781,746,510	0.89
	内 ベルギー	1,960,740,110	2.24
	内 フランス	3,507,323,020	4.00
	内 スペイン	1,069,726,707	1.22
	内 カナダ	2,208,821,722	2.52
	内 アメリカ	42,951,085,331	48.97
	内 オーストラリア	13,465,954,419	15.35
	内 ニュージーランド	888,042,078	1.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,517,617,646	1.73
純資産総額		87,706,924,787	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）		12,474,649	0.01
	内 日本	12,474,649	0.01
為替予約取引（売建）		12,494,921	△0.01
	内 日本	12,494,921	△0.01

(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5月31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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,412,450	1,744.90 4,209,486,900	1,825.95 4,405,021,521	5.02
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	241,963	16,748.63 4,052,550,963	17,374.80 4,204,060,837	4.79
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	363,941	10,001.94 3,640,116,482	10,221.38 3,719,979,295	4.24
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	262,725	14,536.35 3,819,081,798	14,060.86 3,694,139,969	4.21
5	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	699,202	4,369.21 3,054,960,510	4,694.87 3,282,665,500	3.74

6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	217,296	15,563.66 3,381,935,823	14,467.59 3,143,750,023	3.58
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	378,906	8,836.25 3,348,111,704	8,235.24 3,120,385,030	3.56
8	LINK REIT	香港	投資証券	3,447,292	868.00 2,992,326,635	843.83 2,908,935,303	3.32
9	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,707,795	1,361.55 2,325,429,982	1,386.04 2,367,082,770	2.70
10	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	103,115	21,139.09 2,179,768,028	20,562.96 2,120,349,868	2.42
11	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	5,423,277	406.75 2,205,945,036	383.98 2,082,457,019	2.37
12	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,100	96,646.76 1,845,953,152	102,662.46 1,960,853,038	2.24
13	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,805,489	1,097.39 1,981,331,893	1,036.37 1,871,166,551	2.13
14	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	857,027	2,169.22 1,859,152,469	2,051.74 1,758,401,891	2.00
15	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,068,853	349.25 1,421,240,744	397.06 1,615,599,930	1.84
16	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	105,290	15,120.31 1,592,018,345	14,559.84 1,533,005,648	1.75
17	UDR INC	アメリカ	投資証券	273,496	5,680.81 1,553,685,349	5,478.98 1,498,480,208	1.71
18	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	アメリカ	投資証券	566,327	2,690.57 1,523,743,852	2,564.77 1,452,503,880	1.66
19	AMERICOLD REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	354,365	4,064.51 1,440,320,653	4,072.89 1,443,292,429	1.65
20	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	3,661,349	335.13 1,227,106,442	388.86 1,423,784,758	1.62
21	KLEPIERRE	フランス	投資証券	442,376	3,614.46 1,598,951,950	3,170.34 1,402,484,628	1.60
22	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	66,616	21,983.44 1,464,454,694	20,430.18 1,360,976,931	1.55
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	513,819	2,654.93 1,364,196,382	2,536.82 1,303,469,142	1.49
24	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	72,977	19,268.83 1,406,184,384	17,809.49 1,299,683,400	1.48
25	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,225,100	1,104.14 1,352,833,860	1,051.51 1,288,216,245	1.47

26	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	シンガポール	投資証券	9,793,000	128.96 1,263,739,264	126.27 1,236,562,110	1.41
27	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	29,569	40,203.44 1,188,775,600	40,379.55 1,193,983,003	1.36
28	DEXUS/AU	オーストラリア	投資証券	1,607,351	730.38 1,173,979,274	737.66 1,185,689,790	1.35
29	SAFESTORE HOLDINGS PLC	イギリス	投資証券	717,008	1,652.66 1,184,970,697	1,610.97 1,155,081,784	1.32
30	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	4,972,247	228.58 1,136,584,561	230.40 1,145,641,012	1.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.27%
合計	98.27%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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	米ドル買/円売 2023年6月	買建	89,265	12,496,145	12,474,649	0.01%
		ユーロ売/円買 2023年6月	売建	83,285	12,496,145	12,494,921	△0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		142,696,650,200	97.35
	内 日本	142,696,650,200	97.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,882,245,759	2.65
純資産総額		146,578,895,959	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		2,450,291,500	1.67
	内 日本	2,450,291,500	1.67

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

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

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

(2) 投資資産（2023年5月31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	日本ビルファンド	日本	投資証券	20,725	548,012.12 11,357,551,368	558,000.00 11,564,550,000	7.89
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	31,291	310,094.62 9,703,170,942	292,200.00 9,143,230,200	6.24
3	GLP投資法人	日本	投資証券	59,130	152,071.18 8,991,969,428	147,800.00 8,739,414,000	5.96
4	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	24,927	293,176.89 7,308,020,375	292,500.00 7,291,147,500	4.97
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	69,442	99,162.16 6,886,018,794	98,600.00 6,846,981,200	4.67
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	37,462	159,500.00 5,975,189,000	163,900.00 6,140,021,800	4.19
7	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,495	653,727.76 5,553,417,378	678,000.00 5,759,610,000	3.93

8	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	24,920	211,091.50 5,260,400,334	213,800.00 5,327,896,000	3.63
9	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	11,563	421,026.66 4,868,331,365	434,500.00 5,024,123,500	3.43
10	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	15,585	301,609.84 4,700,589,360	316,000.00 4,924,860,000	3.36
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	30,985	149,700.00 4,638,454,500	148,000.00 4,585,780,000	3.13
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	12,431	352,459.56 4,381,424,848	358,000.00 4,450,298,000	3.04
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	12,394	346,438.50 4,293,758,863	359,000.00 4,449,446,000	3.04
14	オリックス不動産投資	日本	投資証券	23,573	177,300.00 4,179,492,900	186,600.00 4,398,721,800	3.00
15	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	7,110	533,000.00 3,789,630,000	530,000.00 3,768,300,000	2.57
16	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	46,776	77,771.41 3,637,835,707	79,100.00 3,699,981,600	2.52
17	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	21,513	163,291.59 3,512,891,989	167,900.00 3,612,032,700	2.46
18	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	14,151	243,343.69 3,443,556,618	251,000.00 3,551,901,000	2.42
19	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	9,221	338,771.78 3,123,814,614	338,500.00 3,121,308,500	2.13
20	イオンリート投資	日本	投資証券	19,328	155,900.00 3,013,235,200	160,600.00 3,104,076,800	2.12
21	産業ファンド	日本	投資証券	18,719	153,702.15 2,877,150,615	160,100.00 2,996,911,900	2.04
22	三井不ロジパーク	日本	投資証券	5,867	520,000.00 3,050,840,000	502,000.00 2,945,234,000	2.01
23	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	46,047	57,469.22 2,646,285,404	59,300.00 2,730,587,100	1.86
24	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,076	323,073.75 2,609,143,612	326,000.00 2,632,776,000	1.80
25	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	32,157	78,100.00 2,511,461,700	79,500.00 2,556,481,500	1.74
26	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	15,210	154,100.00 2,343,861,000	158,700.00 2,413,827,000	1.65
27	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	5,954	394,500.00 2,348,853,000	393,500.00 2,342,899,000	1.60

28	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4,005	483,827.23 1,937,728,077	493,000.00 1,974,465,000	1.35
29	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	12,395	129,900.00 1,610,110,500	129,100.00 1,600,194,500	1.09
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,680	583,000.00 1,562,440,000	580,000.00 1,554,400,000	1.06

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.35%
合計	97.35%

(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
不動産投信指数先物取引	日本	ＴＲＥＩＴ先物　０５０６月	買建	1,303	2,422,928,500	2,450,291,500	1.67%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	3,722,897,361	73.18

	内 カナダ	63,546,683	1.25
	内 アメリカ	3,659,350,678	71.94
ハイブリッド優先証券		872,285,511	17.15
	内 アメリカ	872,285,511	17.15
投資証券		56,962,285	1.12
	内 アメリカ	56,962,285	1.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		434,832,247	8.55
純資産総額		5,086,977,404	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5月31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	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	6,173	39,993.78 246,881,652	46,293.22 285,768,058	5.62
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	11,002	23,091.40 254,051,602	24,781.22 272,642,993	5.36
3	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,541	86,593.10 133,439,976	112,282.83 173,027,844	3.40
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	7,130	15,216.75 108,495,498	17,285.35 123,244,588	2.42
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,279	30,957.65 101,510,158	36,692.42 120,314,446	2.37
6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	6,283	14,327.82 90,021,710	17,004.41 106,838,760	2.10
7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,553	37,399.65 58,081,667	56,063.14 87,066,064	1.71
8	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,872	40,390.73 75,611,455	39,823.26 74,549,158	1.47

9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,027	71,168.50 73,090,090	67,068.63 68,879,488	1.35
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,056	23,179.45 70,836,420	21,576.29 65,937,157	1.30
11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	3,213	21,217.92 68,173,522	20,012.26 64,299,419	1.26
12	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,521	22,617.58 57,018,923	25,411.58 64,062,603	1.26
13	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	3,077	19,390.29 59,663,929	19,212.78 59,117,737	1.16
14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	14,012	4,126.01 57,813,658	3,949.90 55,346,002	1.09
15	KLA CORP	アメリカ	株式	情報技術	859	52,419.34 45,028,214	64,116.69 55,076,239	1.08
16	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,164	47,091.30 54,814,283	46,240.10 53,823,487	1.06
17	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,194	26,957.43 59,144,623	23,727.35 52,057,817	1.02
18	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,525	15,026.67 52,969,021	14,591.98 51,436,758	1.01
19	NIKE INC -CL B	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,406	17,604.03 59,959,331	14,888.30 50,709,551	1.00
20	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	697	68,669.00 47,862,294	71,007.35 49,492,125	0.97
21	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	843	53,025.94 44,700,870	58,313.44 49,158,231	0.97
22	ELEVANCE HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	784	67,712.97 53,086,972	61,740.60 48,404,632	0.95
23	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	1,552	32,708.97 50,764,330	30,978.62 48,078,823	0.95
24	CARDINAL HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,181	11,269.65 47,118,428	11,367.49 47,527,493	0.93
25	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	924	52,054.54 48,098,396	51,365.47 47,461,699	0.93
26	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,093	23,103.98 48,356,632	22,665.10 47,438,061	0.93
27	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	608	64,717.70 39,348,363	76,750.50 46,664,305	0.92

28	BAKER HUGHES CO	アメリカ	株式	エネルギー	11,817	4,026.63 47,582,867	3,885.60 45,916,206	0.90
29	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	1,608	25,857.45 41,578,780	28,116.13 45,210,742	0.89
30	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	626	82,302.16 51,521,156	71,872.52 44,992,203	0.88

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	73.18%
ハイブリッド優先証券	17.15%
投資証券	1.12%
合計	91.45%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.48%
素材	2.02%
資本財・サービス	5.84%
一般消費財・サービス	6.85%
生活必需品	5.53%
ヘルスケア	9.46%
金融	9.39%
情報技術	21.54%
コミュニケーション・サービス	7.29%
公益事業	1.79%
合計	73.18%

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,596,750,815	93.65
	内 スウェーデン	5,019,816	0.29
	内 イギリス	333,670,799	19.57
	内 オランダ	107,124,759	6.28
	内 フランス	348,820,395	20.46
	内 ドイツ	347,552,522	20.38
	内 スイス	322,709,260	18.93
	内 スペイン	24,428,147	1.43
	内 イタリア	107,425,117	6.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		108,260,103	6.35
純資産総額		1,705,010,918	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）		12,002,024	0.70
	内 日本	12,002,024	0.70

(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5月31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	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,885	17,433.94 102,598,759	16,717.94 98,385,109	5.77
2	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,865	22,569.01 64,660,233	24,696.58 70,755,713	4.15
3	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	22,308	3,333.13 74,355,656	3,116.33 69,519,107	4.08

4	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,954	21,929.84 64,780,766	23,505.26 69,434,557	4.07
5	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	953	65,072.52 62,014,118	65,936.66 62,837,640	3.69
6	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,630	13,494.40 62,479,116	13,428.05 62,171,900	3.65
7	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,385	42,743.87 59,200,260	44,425.84 61,529,801	3.61
8	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	4,107	15,310.08 62,878,505	14,150.27 58,115,169	3.41
9	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,094	50,038.34 54,741,944	50,083.35 54,791,187	3.21
10	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	6,645	8,810.34 58,544,768	8,075.15 53,659,390	3.15
11	AXA SA	フランス	株式	金融	12,793	4,308.39 55,117,343	4,045.82 51,758,285	3.04
12	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	3,161	15,556.14 49,172,981	15,631.16 49,410,120	2.90
13	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	12,408	4,276.24 53,059,683	3,963.60 49,180,421	2.88
14	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	45,791	1,014.87 46,471,942	1,042.31 47,728,586	2.80
15	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	50,801	856.42 43,507,414	902.04 45,824,558	2.69
16	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	92,764	481.32 44,649,940	482.67 44,775,204	2.63
17	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	93,308	465.83 43,466,279	455.41 42,493,879	2.49
18	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,845	25,304.24 46,686,334	22,866.09 42,187,947	2.47
19	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,287	6,428.46 40,415,751	6,372.19 40,062,014	2.35
20	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	81	476,509.28 38,597,252	466,479.13 37,784,810	2.22
21	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,208	32,873.76 39,711,507	31,110.79 37,581,839	2.20

22	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財･サービス	9,094	4,415.67 40,156,168	4,115.59 37,427,241	2.20
23	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	18,856	1,942.72 36,631,978	1,910.59 36,026,085	2.11
24	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	106,084	370.29 39,290,727	331.58 35,176,224	2.06
25	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	4,209	8,910.87 37,505,875	8,295.71 34,916,650	2.05
26	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	4,736	7,486.03 35,453,881	7,025.76 33,274,002	1.95
27	GSK	イギリス	株式	ヘルスケア	13,419	2,631.40 35,310,804	2,381.28 31,954,529	1.87
28	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	1,845	16,947.01 31,267,248	17,112.06 31,571,754	1.85
29	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	オランダ	株式	生活必需品	6,864	4,589.72 31,503,863	4,483.94 30,777,801	1.81
30	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	15,660	2,030.43 31,796,629	1,954.01 30,599,836	1.79

(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
株式	93.65%
合計	93.65%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	7.58%
素材	5.64%
資本財・サービス	10.57%
一般消費財・サービス	5.39%
生活必需品	12.02%
ヘルスケア	12.54%
金融	23.66%
情報技術	2.47%
コミュニケーション・サービス	7.55%
公益事業	6.23%

合計	93.65%

(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
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2023年6月	買建	80,000	11,966,957	12,002,024	0.70%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		712,805,321	97.14
	内 韓国	148,150,063	20.19
	内 台湾	200,171,893	27.28
	内 香港	83,496,106	11.38
	内 シンガポール	45,589,059	6.21
	内 オーストラリア	235,398,200	32.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,988,605	2.86
純資産総額		733,793,926	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,124,000	0.29
	内 日本	2,124,000	0.29
為替予約取引（売建）		2,276,475	△0.31
	内 日本	2,276,475	△0.31

(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5月31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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	26,000	2,353.99 61,203,792	2,582.09 67,134,392	9.15
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	8,260	6,913.62 57,106,501	7,678.26 63,422,428	8.64
3	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	9,950	4,230.20 42,090,505	3,960.63 39,408,311	5.37
4	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	24,600	1,508.37 37,105,951	1,364.76 33,573,096	4.58
5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	3,200	9,025.94 28,883,033	9,032.32 28,903,432	3.94
6	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	1,020	27,448.49 27,997,468	28,071.41 28,632,845	3.90
7	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	40,000	476.72 19,069,160	488.13 19,525,360	2.66
8	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財･サービス	4,330	4,703.76 20,367,305	4,489.75 19,440,622	2.65
9	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポール	株式	コミュニケーション･サービス	69,600	258.75 18,009,000	258.75 18,009,000	2.45
10	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	7,200	2,591.85 18,661,336	2,415.17 17,389,270	2.37
11	ASIA CEMENT CORP	台湾	株式	素材	86,000	199.13 17,125,292	200.95 17,282,225	2.36
12	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	31,000	373.17 11,568,320	524.63 16,263,530	2.22
13	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	8,300	2,026.30 16,818,352	1,922.48 15,956,648	2.17
14	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	4,800	3,370.99 16,180,776	3,242.65 15,564,744	2.12

15	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	オーストラリア	株式	金融	7,300	2,183.85 15,942,168	2,131.94 15,563,226	2.12
16	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	3,000	6,147.66 18,442,992	5,152.19 15,456,576	2.11
17	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	920	16,394.42 15,082,868	15,946.35 14,670,648	2.00
18	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	4,478	3,167.41 14,183,683	3,196.55 14,314,182	1.95
19	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	4,000	3,412.37 13,649,504	3,480.80 13,923,224	1.90
20	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	58,000	234.03 13,573,775	235.39 13,653,154	1.86
21	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	1,100	9,483.66 10,432,026	11,713.86 12,885,246	1.76
22	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	シンガポール	株式	金融	9,500	1,328.94 12,624,930	1,264.77 12,015,315	1.64
23	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	1,200	11,014.00 13,216,807	9,953.95 11,944,741	1.63
24	KIA CORP	韓国	株式	一般消費財･サービス	1,300	9,071.23 11,792,610	9,090.72 11,817,936	1.61
25	KT&G CORP	韓国	株式	生活必需品	1,300	8,878.32 11,541,816	8,867.70 11,528,010	1.57
26	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	8,000	1,434.74 11,477,992	1,432.46 11,459,744	1.56
27	LG CORP	韓国	株式	資本財･サービス	1,200	9,781.02 11,737,224	9,356.22 11,227,464	1.53
28	ASUSTEK COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	8,000	1,265.95 10,127,640	1,386.84 11,094,784	1.51
29	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	6,000	1,971.32 11,827,920	1,819.68 10,918,080	1.49
30	SAMSUNG SDS CO LTD	韓国	株式	情報技術	800	12,701.52 10,161,216	13,264.38 10,611,504	1.45

(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	97.14%
合計	97.14%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.95%
素材	12.45%
資本財・サービス	2.47%
一般消費財・サービス	4.26%
生活必需品	1.57%
ヘルスケア	3.90%
金融	26.69%
情報技術	36.77%
コミュニケーション・サービス	3.47%
公益事業	2.12%
不動産	1.49%
合計	97.14%

(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
為替予約取引	日本	韓国ウォン買/円売 2023年6月	買建	20,000,000	2,113,600	2,124,000	0.29%
		豪ドル売/円買 2023年6月	売建	25,000	2,271,640	2,276,475	△0.31%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

株式		20,668,060,540	94.75
	内 日本	20,668,060,540	94.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,144,246,964	5.25
純資産総額		21,812,307,504	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）		212,600,000	0.97
	内 日本	212,600,000	0.97

(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5月31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	東京海上HD	日本	株式	保険業	313,400	2,667.14 835,883,771	3,144.00 985,329,600	4.52
2	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	492,800	1,849.36 911,367,709	1,908.50 940,508,800	4.31
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	177,500	3,981.64 706,742,338	3,955.00 702,012,500	3.22
4	日 立	日本	株式	電気機器	85,000	7,562.30 642,795,634	8,046.00 683,910,000	3.14
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	721,000	873.66 629,915,295	932.50 672,332,500	3.08
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	33,700	15,855.83 534,341,638	19,315.00 650,915,500	2.98
7	AGC	日本	株式	ガラス・土石製品	125,300	5,044.87 632,122,919	5,090.00 637,777,000	2.92
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	106,400	5,251.93 558,805,979	5,586.00 594,350,400	2.72
9	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	213,100	2,026.73 431,897,667	2,207.50 470,418,250	2.16

10	住友電工	日本	株式	非鉄金属	280,200	1,680.82 470,966,359	1,654.00 463,450,800	2.12
11	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	173,800	2,443.45 424,673,310	2,584.00 449,099,200	2.06
12	上 組	日本	株式	倉庫･運輸関連業	142,200	2,850.84 405,389,796	3,105.00 441,531,000	2.02
13	小松製作所	日本	株式	機械	131,100	3,263.57 427,855,233	3,292.00 431,581,200	1.98
14	三井住友ﾄﾗｽﾄHD	日本	株式	銀行業	87,100	4,787.77 417,015,397	4,905.00 427,225,500	1.96
15	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	50,000	6,975.84 348,792,152	8,533.00 426,650,000	1.96
16	九州旅客鉄道	日本	株式	陸運業	133,200	2,994.11 398,815,540	2,983.00 397,335,600	1.82
17	信越化学	日本	株式	化学	92,100	4,160.79 383,208,880	4,297.00 395,753,700	1.81
18	BIPROGY	日本	株式	情報･通信業	115,000	3,217.70 370,035,852	3,365.00 386,975,000	1.77
19	三菱重工業	日本	株式	機械	65,400	5,553.73 363,214,484	5,906.00 386,252,400	1.77
20	ＴＤＫ	日本	株式	電気機器	69,800	4,697.92 327,914,980	5,340.00 372,732,000	1.71
21	デンソー	日本	株式	輸送用機器	40,800	7,596.13 309,922,197	8,611.00 351,328,800	1.61
22	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	207,500	1,564.31 324,594,443	1,624.00 336,980,000	1.54
23	富士電機	日本	株式	電気機器	56,500	5,218.76 294,860,027	5,870.00 331,655,000	1.52
24	アサヒグループホールディン	日本	株式	食料品	60,300	4,938.28 297,778,377	5,409.00 326,162,700	1.50
25	大日本印刷	日本	株式	その他製品	81,800	3,996.76 326,935,272	3,975.00 325,155,000	1.49
26	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	66,900	4,487.32 300,202,496	4,721.00 315,834,900	1.45
27	KDDI	日本	株式	情報･通信業	68,500	4,086.82 279,947,531	4,291.00 293,933,500	1.35
28	MS＆AD	日本	株式	保険業	60,800	4,352.55 264,635,467	4,798.00 291,718,400	1.34
29	ﾄﾖﾀ紡織	日本	株式	輸送用機器	117,200	2,124.14 248,949,995	2,275.00 266,630,000	1.22

30	光通信	日本	株式	情報･通信業	12,500	18,349.89 229,373,749	20,170.00 252,125,000	1.16

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.75%
合計	94.75%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	0.77%
建設業	1.65%
食料品	2.44%
繊維製品	1.34%
パルプ・紙	0.89%
化学	9.16%
医薬品	2.16%
ガラス・土石製品	2.92%
鉄鋼	1.32%
非鉄金属	3.28%
金属製品	0.60%
機械	5.72%
電気機器	10.60%
輸送用機器	9.26%
精密機器	0.53%
その他製品	1.49%
電気・ガス業	2.15%
陸運業	1.82%
倉庫・運輸関連業	2.56%
情報・通信業	7.70%
卸売業	8.67%
小売業	2.04%
銀行業	6.09%
証券、商品先物取引業	0.12%
保険業	5.85%
その他金融業	0.51%
不動産業	2.34%

サービス業	0.79%
合計	94.75%

(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	ＴＯＰＩＸ先物　０５０６月	買建	10	214,455,500	212,600,000	0.97%

(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。

（参考情報）運用実績

●安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

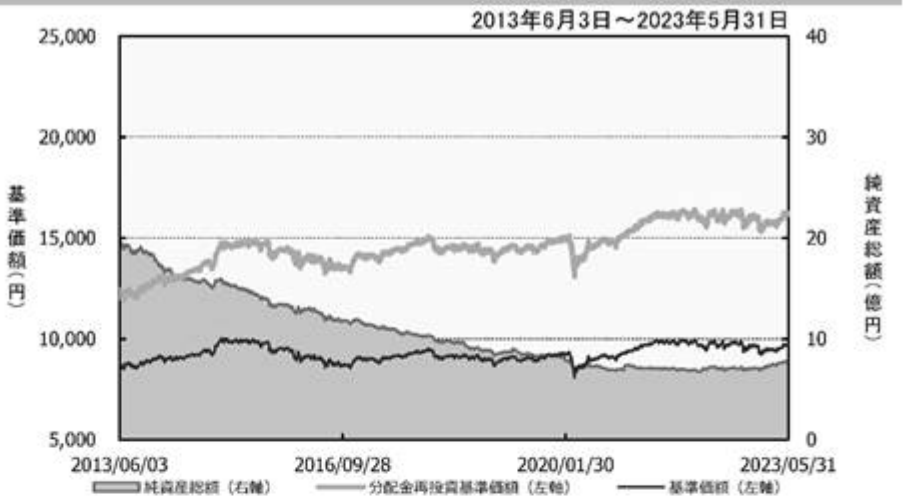
2023年5月31日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,720円
純資産総額	7.7億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	2.8%
6カ月間	1.2%
1年間	0.6%
3年間	12.8%
5年間	12.5%
設定来	62.3%



※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：　90円　　設定来分配金合計額：　4,545円

決算期	第94期 21年7月	第95期 21年9月	第96期 21年11月	第97期 22年1月	第98期 22年3月	第99期 22年5月	第100期 22年7月	第101期 22年9月	第102期 22年11月	第103期 23年1月	第104期 23年3月	第105期 23年5月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15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	43	34.0%
国内債券	32	33.9%
国内株式・先物	97	9.8%
外国株式	160	8.8%
国内リート・先物	46	5.0%
外国リート	72	4.9%
外国優先出資証券	53	0.6%
コール・ローン、その他		3.3%
合計	503	-

通貨別構成	比率
日本円	50.3%
米ドル	15.1%
ユーロ	10.8%
豪ドル	5.7%
英ポンド	5.3%
カナダ・ドル	4.6%
ポーランド・ズロチ	1.8%
デンマーク・クローネ	1.1%
ノルウェー・クローネ	1.1%
その他	4.2%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.0
最終利回り(%)	2.0
修正デュレーション	7.2
残存年数	8.4

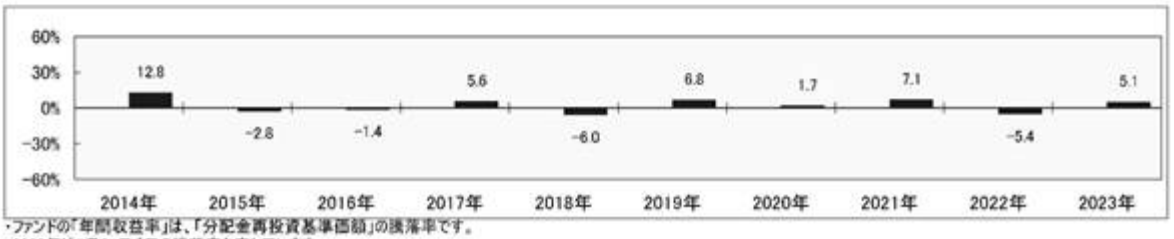
債券格付別構成	比率
AAA	88.5%
AA	8.0%
A	3.5%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	東京海上HD	日本	0.5%
株式	トヨタ自動車	日本	0.4%
株式	日本電信電話	日本	0.3%
株式	日 立	日本	0.3%
株式	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
リート	日本プロロジスリート	日本	0.3%
リート	GLP投資法人	日本	0.3%
リート	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.3%
リート	大和ハウスリート投資法人	日本	0.2%
合計			3.4%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は5月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		591,859,061	98.82
	内 日本	591,859,061	98.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,078,734	1.18
純資産総額		598,937,795	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5月31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	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	222,921,777	1.8717 417,264,982	1.8804 419,182,109	69.99
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	14,660,942	3.9946 58,566,065	4.0562 59,467,712	9.93
3	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,344,318	3.4235 28,566,773	3.4647 28,910,558	4.83
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,821,382	3.5024 27,393,608	3.5025 27,394,390	4.57
5	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,147,132	2.9881 18,368,245	3.1277 19,226,384	3.21
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,915,157	4.6052 18,030,081	4.8637 19,042,149	3.18
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,397,491	2.5431 18,813,299	2.5192 18,635,759	3.11

(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	98.82%

合計	98.82%

(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16特定期間末 (2013年11月11日)	2,037,542,941	2,050,246,699	0.8019	0.8069
第17特定期間末 (2014年5月12日)	1,862,809,605	1,873,889,871	0.8406	0.8456
第18特定期間末 (2014年11月10日)	1,743,601,679	1,750,248,132	0.9182	0.9217
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,566,235,861	1,572,032,654	0.9457	0.9492
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,377,538,151	1,381,348,553	0.9038	0.9063
第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,182,765,323	1,186,295,037	0.8377	0.8402
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,075,473,727	1,078,862,289	0.7935	0.7960
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,046,739,352	1,048,578,766	0.8536	0.8551
第24特定期間末 (2017年11月10日)	944,076,847	945,657,477	0.8959	0.8974
第25特定期間末 (2018年5月10日)	882,622,419	884,155,888	0.8634	0.8649
第26特定期間末 (2018年11月12日)	824,034,111	825,480,307	0.8547	0.8562

第27特定期間末 (2019年5月10日)	766,179,336	767,537,727	0.8461	0.8476
第28特定期間末 (2019年11月11日)	745,325,595	746,608,415	0.8715	0.8730
第29特定期間末 (2020年5月11日)	618,770,175	619,893,950	0.8259	0.8274
第30特定期間末 (2020年11月10日)	643,652,906	644,740,886	0.8874	0.8889
第31特定期間末 (2021年5月10日)	634,877,275	635,866,223	0.9630	0.9645
第32特定期間末 (2021年11月10日)	628,637,499	629,608,621	0.9710	0.9725
第33特定期間末 (2022年5月10日)	607,273,176	608,248,456	0.9340	0.9355
2022年5月末日	615,964,117	－	0.9556	－
6月末日	607,375,898	－	0.9555	－
7月末日	618,489,525	－	0.9745	－
8月末日	616,140,544	－	0.9574	－
9月末日	589,742,744	－	0.9197	－
10月末日	614,420,817	－	0.9574	－
第34特定期間末 (2022年11月10日)	603,572,869	604,530,886	0.9450	0.9465
11月末日	607,590,104	－	0.9477	－
12月末日	575,745,101	－	0.8982	－
2023年1月末日	590,178,011	－	0.9205	－
2月末日	586,488,127	－	0.9227	－
3月末日	585,304,116	－	0.9272	－
4月末日	591,937,129	－	0.9374	－
第35特定期間末 (2023年5月10日)	598,388,456	599,335,879	0.9474	0.9489
5月末日	598,937,795	－	0.9543	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0135
第19特定期間	0.0105
第20特定期間	0.0095

第21特定期間	0.0075
第22特定期間	0.0075
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045
第34特定期間	0.0045
第35特定期間	0.0045

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第16特定期間	△5.4
第17特定期間	6.7
第18特定期間	10.8
第19特定期間	4.1
第20特定期間	△3.4
第21特定期間	△6.5
第22特定期間	△4.4
第23特定期間	8.1
第24特定期間	5.5
第25特定期間	△3.1
第26特定期間	△0.5
第27特定期間	△0.5
第28特定期間	3.5
第29特定期間	△4.7
第30特定期間	8.0
第31特定期間	9.0
第32特定期間	1.3
第33特定期間	△3.3
第34特定期間	1.7
第35特定期間	0.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第16特定期間	15,453,145	345,691,091
第17特定期間	11,255,874	335,954,300
第18特定期間	9,451,531	326,518,165
第19特定期間	29,475,271	272,235,197
第20特定期間	46,300,831	178,366,471
第21特定期間	24,051,624	136,327,052
第22特定期間	10,094,094	66,554,667
第23特定期間	6,086,004	135,234,627
第24特定期間	10,558,332	183,081,271
第25特定期間	12,683,654	44,124,014
第26特定期間	5,144,673	63,327,127
第27特定期間	7,944,020	66,480,539
第28特定期間	4,826,658	55,206,979
第29特定期間	5,358,492	111,388,864
第30特定期間	10,162,525	34,025,491
第31特定期間	5,581,535	71,602,996
第32特定期間	14,180,659	26,064,725
第33特定期間	23,352,696	20,580,867
第34特定期間	32,754,614	44,263,112
第35特定期間	20,401,505	27,464,172

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2023年5月31日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,543円
純資産総額	5.9億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.0%
3カ月間	3.8%
6カ月間	1.2%
1年間	0.8%
3年間	15.9%
5年間	17.8%
設定来	77.6%

※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：　90円　　設定来分配金合計額：　5,175円

決算期	第94期 21年7月	第95期 21年9月	第96期 21年11月	第97期 22年1月	第98期 22年3月	第99期 22年5月	第100期 22年7月	第101期 22年9月	第102期 22年11月	第103期 23年1月	第104期 23年3月	第105期 23年5月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15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	43	68.3%
国内株式・先物	97	9.5%
外国株式	160	8.4%
国内リート・先物	46	4.8%
外国リート	72	4.5%
外国優先出資証券	53	0.5%
コール・ローン、その他		4.2%
合計	471	-

通貨別構成	比率
米ドル	24.2%
ユーロ	19.3%
日本円	16.0%
豪ドル	9.4%
英ポンド	9.3%
カナダ・ドル	8.9%
ポーランド・ズロチ	3.7%
デンマーク・クローネ	2.3%
ノルウェー・クローネ	2.2%
その他	4.8%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.1
最終利回り(%)	3.8
修正デュレーション	7.7
残存年数	9.4
合計	100.0%

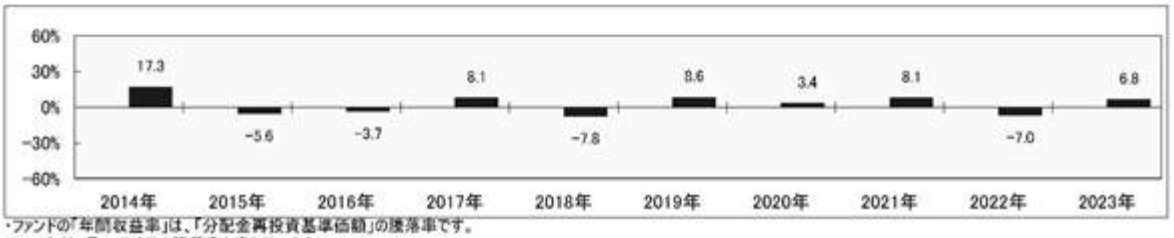
債券格付別構成	比率
AAA	77.0%
AA	16.0%
A	6.9%
BBB	-
BB	-

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	東京海上HD	日本	0.4%
	トヨタ自動車	日本	0.4%
	日本電信電話	日本	0.3%
	日 立	日本	0.3%
	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
	日本プロロジスリート	日本	0.3%
	GLP投資法人	日本	0.3%
	大和ハウスリート投資法人	日本	0.2%
	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.2%
	合計		3.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は5月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（2023年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		3,014,384,483	99.16
	内 日本	3,014,384,483	99.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		25,470,655	0.84
純資産総額		3,039,855,138	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5月31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	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	263,135,667	3.9947 1,051,148,053	4.0562 1,067,330,892	35.11
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	315,634,835	1.8718 590,805,284	1.8804 593,519,743	19.52
3	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	73,910,620	4.6051 340,373,187	4.8637 359,479,082	11.83
4	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	113,846,350	2.9881 340,189,901	3.1277 356,077,228	11.71
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	138,344,308	2.5432 351,837,250	2.5192 348,516,980	11.46
6	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	42,312,391	3.4235 144,856,470	3.4647 146,599,741	4.82
7	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	40,788,242	3.5024 142,856,738	3.5025 142,860,817	4.70

(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	99.16%

合計	99.16%

(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16特定期間末 (2013年11月11日)	9,327,922,637	9,372,482,501	0.8373	0.8413
第17特定期間末 (2014年5月12日)	8,513,202,227	8,552,128,762	0.8748	0.8788
第18特定期間末 (2014年11月10日)	8,133,973,146	8,166,656,270	0.9955	0.9995
第19特定期間末 (2015年5月11日)	7,225,488,064	7,395,649,150	1.0191	1.0431
第20特定期間末 (2015年11月10日)	6,532,848,494	6,559,720,979	0.9724	0.9764
第21特定期間末 (2016年5月10日)	5,551,044,127	5,576,599,040	0.8689	0.8729
第22特定期間末 (2016年11月10日)	5,116,194,834	5,140,460,598	0.8434	0.8474
第23特定期間末 (2017年5月10日)	5,287,390,510	5,309,662,342	0.9496	0.9536
第24特定期間末 (2017年11月10日)	5,057,631,350	5,077,504,216	1.0180	1.0220
第25特定期間末 (2018年5月10日)	4,653,393,092	4,672,305,292	0.9842	0.9882
第26特定期間末 (2018年11月12日)	4,168,672,375	4,186,518,075	0.9344	0.9384

第27特定期間末 (2019年5月10日)	3,794,279,955	3,811,358,261	0.8887	0.8927
第28特定期間末 (2019年11月11日)	3,761,340,903	3,777,373,246	0.9384	0.9424
第29特定期間末 (2020年5月11日)	3,058,775,631	3,073,722,465	0.8186	0.8226
第30特定期間末 (2020年11月10日)	3,291,713,061	3,306,146,732	0.9122	0.9162
第31特定期間末 (2021年5月10日)	3,395,326,766	3,475,919,783	1.0532	1.0782
第32特定期間末 (2021年11月10日)	3,185,913,394	3,263,859,118	1.0218	1.0468
第33特定期間末 (2022年5月10日)	3,014,446,103	3,026,728,646	0.9817	0.9857
2022年5月末日	3,116,328,383	－	1.0149	－
6月末日	3,037,896,794	－	1.0005	－
7月末日	3,063,289,471	－	1.0118	－
8月末日	3,044,777,330	－	1.0118	－
9月末日	2,888,762,661	－	0.9583	－
10月末日	3,014,680,550	－	1.0033	－
第34特定期間末 (2022年11月10日)	2,994,351,205	3,006,325,092	1.0003	1.0043
11月末日	3,023,913,420	－	1.0116	－
12月末日	2,860,197,359	－	0.9676	－
2023年1月末日	2,955,796,615	－	0.9999	－
2月末日	2,963,131,463	－	1.0110	－
3月末日	2,926,153,793	－	1.0008	－
4月末日	2,989,107,019	－	1.0210	－
第35特定期間末 (2023年5月10日)	3,016,621,443	3,031,263,507	1.0301	1.0351
5月末日	3,039,855,138	－	1.0473	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0620
第20特定期間	0.0120

第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0170
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120
第30特定期間	0.0120
第31特定期間	0.0330
第32特定期間	0.0650
第33特定期間	0.0230
第34特定期間	0.0130
第35特定期間	0.0140

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第16特定期間	△1.9
第17特定期間	5.9
第18特定期間	15.2
第19特定期間	8.6
第20特定期間	△3.4
第21特定期間	△9.4
第22特定期間	△1.6
第23特定期間	14.0
第24特定期間	8.5
第25特定期間	△1.7
第26特定期間	△3.8
第27特定期間	△3.6
第28特定期間	6.9
第29特定期間	△11.5
第30特定期間	12.9
第31特定期間	19.1
第32特定期間	3.2
第33特定期間	△1.7
第34特定期間	3.2
第35特定期間	4.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第16特定期間	42,879,794	1,446,517,832
第17特定期間	54,417,883	1,462,750,164
第18特定期間	33,525,544	1,594,378,200
第19特定期間	75,174,262	1,155,910,225
第20特定期間	80,486,286	452,410,273
第21特定期間	25,129,059	354,521,879
第22特定期間	35,863,134	358,150,519
第23特定期間	29,786,290	528,269,188
第24特定期間	54,376,920	654,118,402
第25特定期間	42,388,187	282,554,834
第26特定期間	24,330,190	290,955,202
第27特定期間	29,326,275	221,174,687
第28特定期間	27,601,125	289,091,902
第29特定期間	27,702,752	299,080,075
第30特定期間	31,943,313	160,233,931
第31特定期間	24,319,139	409,016,346
第32特定期間	53,510,881	159,402,589
第33特定期間	60,334,741	107,527,878
第34特定期間	57,102,598	134,266,503
第35特定期間	58,018,990	123,078,128

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2023年5月31日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,473円
純資産総額	30億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.1%
3カ月間	4.6%
6カ月間	5.0%
1年間	6.0%
3年間	44.1%
5年間	33.5%
設定来	140.6%

※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：　270円　　設定来分配金合計額：　7,680円

決算期	第 94 期 21年7月	第 95 期 21年9月	第 96 期 21年11月	第 97 期 22年1月	第 98 期 22年3月	第 99 期 22年5月	第 100 期 22年7月	第 101 期 22年9月	第 102 期 22年11月	第 103 期 23年1月	第 104 期 23年3月	第 105 期 23年5月
分配金	250円	150円	250円	150円	40円	40円	40円	50円	40円	40円	50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
国内株式・先物	97	33.6%
外国株式	160	30.8%
外国債券	43	19.1%
国内リート・先物	46	4.8%
外国リート	72	4.8%
外国優先出資証券	53	2.0%
コール・ローン、その他		5.4%
合計	471	-

通貨別構成	比率
日本円	41.0%
米ドル	19.1%
ユーロ	11.7%
豪ドル	6.6%
英ポンド	5.2%
台湾ドル	3.4%
カナダ・ドル	2.9%
韓国ウォン	2.4%
スイス・フラン	2.3%
その他	5.4%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.1
最終利回り(%)	3.8
修正デュレーション	7.7
残存年数	9.4

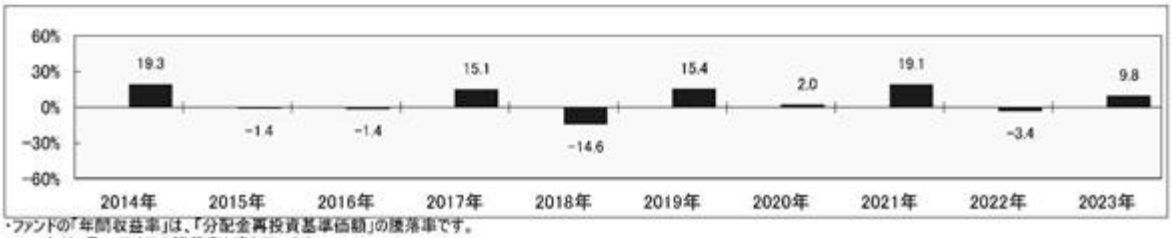
債券格付別構成	比率
AAA	77.0%
AA	16.0%
A	6.9%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	東京海上HD	日本	1.6%
株式	トヨタ自動車	日本	1.5%
株式	日本電信電話	日本	1.1%
株式	日 立	日本	1.1%
株式	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.1%
リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
リート	日本プロロジスリート	日本	0.3%
リート	GLP投資法人	日本	0.3%
リート	大和ハウスリート投資法人	日本	0.2%
リート	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.2%
合計			7.9%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は5月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（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
安定重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	1.34%	1.31%	0.03%
インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	1.43%	1.40%	0.03%
成長重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	1.52%	1.48%	0.04%

※対象期間は2022年11月11日～2023年5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。
※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、委託会社および販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパ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。

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパ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、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- 海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)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。

(4)【計算期間】

毎年1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、および11月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2005年11月14日から2006年1月10日までとします。

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

(5)【その他】

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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

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）を毎年5月および11月の計算期間の末日ならびに償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
・委託会社のホームページ
アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

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】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(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か月未満であるため、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、当特定期間(2022年11月11日から2023年5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】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,331,026	9,890,056
親投資信託受益証券	691,883,886	761,994,258
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	705,214,912	771,884,314
資産合計	705,214,912	771,884,314
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,090,475	1,193,866
未払解約金	2,521,935	-
未払受託者報酬	62,496	69,175
未払委託者報酬	1,437,673	1,591,369
その他未払費用	29,196	29,706
流動負債合計	5,141,775	2,884,116
負債合計	5,141,775	2,884,116
純資産の部		
元本等		
元本	※1 726,983,389	※1 795,910,702
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 26,910,252	※2 △ 26,910,504
（分配準備積立金）	28,562,229	30,219,768
元本等合計	700,073,137	769,000,198
純資産合計	700,073,137	769,000,198
負債純資産合計	705,214,912	771,884,314

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2022年5月11日 至　2022年11月10日	当期 自　2022年11月11日 至　2023年5月10日
営業収益		
受取利息	1	2
有価証券売買等損益	10,909,251	12,110,372
営業収益合計	10,909,252	12,110,374
営業費用		
支払利息	1,255	1,525
受託者報酬	195,231	198,629
委託者報酬	※1 4,491,307	※1 4,569,414
その他費用	29,196	29,706
営業費用合計	4,716,989	4,799,274
営業利益	6,192,263	7,311,100
経常利益	6,192,263	7,311,100
当期純利益	6,192,263	7,311,100
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 14,414	△ 69,827
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 30,248,821	△ 26,910,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,406,581	2,022,822
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,406,581	2,022,822
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,003,873	5,892,974
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,003,873	5,892,974
分配金	※2 3,270,816	※2 3,511,027
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 26,910,252	△ 26,910,504

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
1. ※1 期首元本額	732,737,859円	726,983,389円
期中追加設定元本額	39,944,612円	107,674,511円
期中一部解約元本額	45,699,082円	38,747,198円
2. 特定期間末日における受益権の総数	726,983,389口	795,910,702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26,910,252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26,910,504円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期 自2022年5月11日 至2022年11月10日	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	198,808円	207,296円

2．　※2 分配金の計算過程	(自2022年5月11日至2022年7月11日) 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（2,330,063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（6,834,530円）及び分配準備積立金（26,744,828円）より分配対象額は35,909,421円（1万口当たり493.97円）であり、うち1,090,441円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 (自2022年7月12日至2022年9月12日) 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（2,457,717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（7,265,321円）及び分配準備積立金（27,541,544円）より分配対象額は37,264,582円（1万口当たり512.86円）であり、うち1,089,900円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	(自2022年11月11日至2023年1月10日) 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（1,006,829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（10,026,912円）及び分配準備積立金（27,991,042円）より分配対象額は39,024,783円（1万口当たり515.08円）であり、うち1,136,466円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 (自2023年1月11日至2023年3月10日) 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（2,228,505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（12,140,751円）及び分配準備積立金（27,256,585円）より分配対象額は41,625,841円（1万口当たり528.83円）であり、うち1,180,695円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

	(自2022年9月13日至2022年11月10日) 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（1,308,493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（7,873,823円）及び分配準備積立金（28,344,211円）より分配対象額は37,526,527円（1万口当たり516.20円）であり、うち1,090,475円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	(自2023年3月11日至2023年5月10日) 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（3,355,155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（12,864,665円）及び分配準備積立金（28,058,479円）より分配対象額は44,278,299円（1万口当たり556.32円）であり、うち1,193,866円（1万口当たり15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	当期 自2022年11月11日 至2023年5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、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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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	当期 2023年5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	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の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	△13,371,095	20,207,081
合計	△13,371,095	20,207,081

(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

前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5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)

当期 自2022年11月11日 至2023年5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）

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9630円 (9,630円)	0.9662円 (9,662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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	143,453,129	268,515,566	
	ダイワ日本国債マザーファンド	211,746,013	263,390,865	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	11,023,195	38,607,638	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	19,566,691	78,163,060	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	5,337,594	24,580,687	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	10,162,732	25,845,860	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	8,239,994	24,621,926	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	11,178,226	38,268,656	
親投資信託受益証券 合計			761,994,258	
合計			761,994,258	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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、当ファンドの特定期間末日（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。

「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11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	142,349,116	148,764,125
コール・ローン	50,560,248	11,478,913
国債証券	16,059,143,440	14,753,028,502
特殊債券	972,963,533	1,673,872,753
派生商品評価勘定	2,261,250	10,057,623
未収利息	124,102,378	111,856,876
前払費用	3,080,569	5,149,011
差入委託証拠金	158,732,160	154,965,381
流動資産合計	17,513,192,694	16,869,173,184
資産合計	17,513,192,694	16,869,173,184
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,573,526	7,376,657
未払解約金	23,730,899	6,101,521
流動負債合計	32,304,425	13,478,178
負債合計	32,304,425	13,478,178
純資産の部		
元本等		
元本　※1	9,344,728,210	9,005,302,350
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,136,160,059	7,850,392,656
元本等合計	17,480,888,269	16,855,695,006

純資産合計	17,480,888,269	16,855,695,006
負債純資産合計	17,513,192,694	16,869,173,184

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11月11日 至2023年5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11月10日現在	2023年5月10日現在
1. ※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	10,020,943,402円	9,344,728,210円
期中追加設定元本額	79,127,300円	104,050,662円
期中一部解約元本額	755,342,492円	443,476,522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）	1,232,081,515円	1,220,054,675円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	582,846,104円	550,105,900円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	42,644,846円	43,417,814円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	129,530,727円	143,453,129円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	223,940,161円	224,525,112円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	315,576,186円	315,634,835円
６資産バランスファンド（分配型）	728,933,523円	698,534,823円
６資産バランスファンド（成長型）	100,451,565円	99,981,852円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	3,729,179,355円	3,479,312,972円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	40,219,787円	38,063,954円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	146,935,806円	139,922,704円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	657,007,548円	629,553,078円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	154,122,362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）	653,946,200円	641,476,769円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	24,580,463円	23,395,680円

四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	474,208,742円	502,550,632円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	108,523,320円	105,080,417円
計	9,344,728,210円	9,005,302,350円
2. 期末日における受益権の総数	9,344,728,210口	9,005,302,350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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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5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11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	189,765,504	△220,533,535
特殊債券	△297,047	△11,168,252
合計	189,468,457	△231,701,787

（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11月10日現在				2023年5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)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	711,893,248	-	710,041,196	1,852,052	730,455,753	-	737,826,070	△7,370,317
ポーランド・ズロチ	314,021,248	-	314,430,446	△409,198	304,529,753	-	308,720,410	△4,190,657
ユーロ	397,872,000	-	395,610,750	2,261,250	425,926,000	-	429,105,660	△3,179,660
買建	711,893,248	-	703,728,920	△8,164,328	674,771,153	-	684,822,436	10,051,283

アメリカ・ドル	294,720,000	-	291,347,768	△3,372,232	293,540,000	-	298,383,432	4,843,432
オーストラリア・ドル	103,152,000	-	102,731,152	△420,848	102,739,000	-	105,620,004	2,881,004
ノルウェー・クローネ	314,021,248	-	309,650,000	△4,371,248	278,492,153	-	280,819,000	2,326,847
合計	1,423,786,496	-	1,413,770,116	△6,312,276	1,405,226,906	-	1,422,648,506	2,680,966

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
1口当たり純資産額	1.8707円	1.8718円
（1万口当たり純資産額）	(18,707円)	(18,718円)

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考

国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	6,307,800.000	5,981,686.740	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	5,000,511.600	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	19,807,400.000	16,477,181.830	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,500,000.000	1,080,465.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	1,050,000.000	1,028,706.000	
	アメリカ・ドル 小計			29,568,551.170 (3,996,189,690)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	3,020,000.000	2,814,428.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,882,272.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	594,874.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,335,519.900	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	930,780.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	900,000.000	935,424.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	999,730.000	
	イギリス・ポンド 小計			11,493,028.500 (1,961,285,314)	
	オーストラリア・ドル	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	8,500,000.000	9,248,765.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	5,000,000.000	3,130,150.000	
	オーストラリア・ドル 小計			12,378,915.000 (1,131,432,831)	
	カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,585,200.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,700,000.000	1,590,282.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	7,046,000.000	5,894,613.140	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	925,670.000	
カナダ・ドル 小計			9,995,765.140 (1,009,472,321)	
スウェーデン・クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	13,630,000.000	13,494,926.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	13,489,613.100	
スウェーデン・クローナ 小計			26,984,539.800 (357,814,998)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	6,775,670.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	19,746,712.000	
デンマーク・クローネ 小計			26,522,382.000 (528,060,626)	
ノルウェー・クローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	19,890,200.000	
ノルウェー・クローネ 小計			19,890,200.000 (254,395,658)	
ポーランド・ズロチ	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,500,000.000	3,338,685.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	6,000,000.000	5,461,800.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	8,000,000.000	5,876,240.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	21,857,250.000	
ポーランド・ズロチ 小計			36,533,975.000 (1,189,765,431)	
ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	698,245.650	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	6,210,400.000	6,116,312.440	
	0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,069,866.000	
	FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,400,000.000	1,087,058.000	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,040,889.500	

		1% IRISH TREASURY 20260515	1,172,000.000	1,118,674.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,193,846.260	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	5,660,000.000	5,510,123.200	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	8,475,741.280	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	864,253.000	
	ユーロ 小計			29,175,009.330 (4,324,611,633)	
国債証券 合計				14,753,028,502 [14,753,028,502]	
特殊債券	オーストラリア・ドル	1.25% INTL. FIN. CORP. 20310206	5,600,000.000	4,475,688.000	
		1.1% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20261216	2,500,000.000	2,268,600.000	
	オーストラリア・ドル 小計			6,744,288.000 (616,427,923)	
	カナダ・ドル	2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	6,230,000.000	5,996,063.500	
		3.55% CANADA HOUSING TRUST 20320915	3,000,000.000	3,043,560.000	
		3.65% CANADA HOUSING TRUST 20330615	1,400,000.000	1,431,164.000	
	カナダ・ドル 小計			10,470,787.500 (1,057,444,830)	
特殊債券 合計				1,673,872,753 [1,673,872,753]	
合計				16,426,901,255 [16,426,901,255]	

（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%	24.3%

イギリス・ポンド	国債証券	7銘柄	100%	11.9%
オーストラリア・ドル	国債証券	2銘柄	100%	10.6%
	特殊債券	2銘柄		
カナダ・ドル	国債証券	4銘柄	100%	12.6%
	特殊債券	3銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券	2銘柄	100%	2.2%
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%	7.2%
ユーロ	国債証券	10銘柄	100%	26.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本国債マザーファンド」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11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	345,798,889	329,936,421
国債証券	119,739,126,770	108,171,177,540
未収利息	529,324,445	439,655,520
前払費用	1,808,217	2,189,036
流動資産合計	120,616,058,321	108,942,958,517
資産合計	120,616,058,321	108,942,958,517
負債の部		
流動負債		
未払解約金	63,608,217	35,429,435
流動負債合計	63,608,217	35,429,435
負債合計	63,608,217	35,429,435
純資産の部		
元本等		

元本　※1	96,954,173,219	87,554,031,664
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	23,598,276,885	21,353,497,418
元本等合計	120,552,450,104	108,907,529,082
純資産合計	120,552,450,104	108,907,529,082
負債純資産合計	120,616,058,321	108,942,958,517

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11月11日 至2023年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
1.　※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	107,223,954,714円	96,954,173,219円
期中追加設定元本額	482,727,437円	403,470,661円
期中一部解約元本額	10,752,508,932円	9,803,612,216円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	38,534円	33,554円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	197,909,490円	211,746,013円
６資産バランスファンド（分配型）	219,185,346円	203,799,310円

６資産バランスファンド（成長型）	150,342,088円	147,117,278円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	88,640,505,701円	80,579,979,360円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	59,533,759円	56,288,185円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	32,652,661円	31,045,331円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	7,654,005,640円	6,318,530,522円
目標利回り追求型債券ファンド	-円	5,492,111円
計	96,954,173,219円	87,554,031,664円
2. 期末日における受益権の総数	96,954,173,219口	87,554,031,664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11月11日 至2023年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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5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	2022年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,266,523,830	828,179,980
合計	△2,266,523,830	828,179,980

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2434円 (12,434円)	1.2439円 (12,439円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
国債証券	１　３０年国債	3,550,000,000	4,138,874,000	
	１２　３０年国債	4,100,000,000	4,779,165,000	
	１５　３０年国債	2,100,000,000	2,548,749,000	

	１６　３０年国債	3,900,000,000	4,743,648,000	
	１９　３０年国債	2,200,000,000	2,638,592,000	
	２０　３０年国債	3,800,000,000	4,654,962,000	
	２３　３０年国債	300,000,000	369,498,000	
	２４　３０年国債	3,600,000,000	4,440,600,000	
	２６　３０年国債	2,100,000,000	2,572,080,000	
	２７　３０年国債	3,800,000,000	4,717,206,000	
	２８　３０年国債	2,000,000,000	2,487,820,000	
	６３　２０年国債	3,900,000,000	3,908,424,000	
	６８　２０年国債	3,025,000,000	3,085,681,500	
	７０　２０年国債	3,638,000,000	3,739,645,720	
	７５　２０年国債	3,374,000,000	3,509,499,840	
	８０　２０年国債	3,573,000,000	3,735,607,230	
	８６　２０年国債	3,200,000,000	3,414,688,000	
	８８　２０年国債	3,060,000,000	3,282,400,800	
	９４　２０年国債	3,600,000,000	3,890,844,000	
	９５　２０年国債	3,105,000,000	3,394,292,850	
	１０１　２０年国債	3,460,000,000	3,843,748,600	
	１０２　２０年国債	3,100,000,000	3,458,918,000	
	１０６　２０年国債	300,000,000	333,063,000	
	１１０　２０年国債	3,000,000,000	3,339,660,000	
	１１６　２０年国債	2,700,000,000	3,067,362,000	
	１２１　２０年国債	4,100,000,000	4,595,649,000	
	１２５　２０年国債	2,300,000,000	2,642,562,000	
	１３０　２０年国債	4,100,000,000	4,605,407,000	
	１３４　２０年国債	2,400,000,000	2,707,104,000	
	１４０　２０年国債	4,100,000,000	4,599,626,000	
	１４３　２０年国債	2,200,000,000	2,451,526,000	
	１４５　２０年国債	2,200,000,000	2,474,274,000	
国債証券　合計			108,171,177,540	
合計			108,171,177,540	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		1,864,479,306	1,051,437,883
コール・ローン		312,973,447	125,938,627
投資証券		90,495,793,438	86,959,569,670
派生商品評価勘定		26,475	55,301
未収入金		410,513,008	1,296,499,022
未収配当金		82,153,314	204,136,213
流動資産合計		93,165,938,988	89,637,636,716
資産合計		93,165,938,988	89,637,636,716
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		126,395	663,749
未払金		491,351,224	750,145,167
未払解約金		10,000,000	87,333,000
流動負債合計		501,477,619	838,141,916
負債合計		501,477,619	838,141,916
純資産の部			
元本等			
元本	※1	26,375,181,074	25,353,786,625
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		66,289,280,295	63,445,708,175
元本等合計		92,664,461,369	88,799,494,800
純資産合計		92,664,461,369	88,799,494,800
負債純資産合計		93,165,938,988	89,637,636,716

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11月11日 至2023年5月10日

1．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産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．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．　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11月10日現在	2023年5月10日現在
1. ※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	27,183,521,489円	26,375,181,074円
期中追加設定元本額	801,315,341円	619,330,382円
期中一部解約元本額	1,609,655,756円	1,640,724,831円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
グローバルＲＥＩＴ・オープン（適格機関投資家専用）	-円	827,530円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（毎月分配型）	21,098,403,975円	20,002,937,004円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	21,406,494円	21,644,855円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,238,623円	11,023,195円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,387,412円	7,821,382円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	40,418,396円	40,788,242円
６資産バランスファンド（分配型）	72,551,346円	72,431,226円
６資産バランスファンド（成長型）	211,904,813円	206,926,719円
りそな ワールド・リート・ファンド	962,981,841円	928,437,940円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	20,521,015円	19,970,734円
常陽３分法ファンド	92,469,284円	92,469,284円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	23,768,754円	22,948,526円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／毎月分配型）	40,035,041円	48,268,169円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジなし／資産成長型）	624,329,927円	580,215,257円

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／資産成長型）	567,580,160円	621,464,812円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	343,710,856円	367,890,018円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	447,061,884円	476,733,192円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	679,311,932円	737,789,699円
グローバルＲＥＩＴファンド2021-07（適格機関投資家専用）	844,256,696円	832,945,758円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	223,912,549円	215,441,609円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）	18,334,210円	18,978,409円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	24,595,866円	25,833,065円
計	26,375,181,074円	25,353,786,625円
2. 期末日における受益権の総数	26,375,181,074口	25,353,786,625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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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5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11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△8,089,772,422	△77,001,189
合計	△8,089,772,422	△77,001,189

（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11月10日現在				2023年5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	67,696,703	-	67,670,228	26,475	456,377,003	-	456,321,702	55,301
アメリカ・ドル	-	-	-	-	106,487,300	-	106,471,542	15,758
イギリス・ポンド	38,649,824	-	38,636,195	13,629	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	258,154,389	-	258,126,991	27,398
シンガポール・ドル	29,046,879	-	29,034,033	12,846	6,763,857	-	6,763,093	764
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	44,807,324	-	44,800,835	6,489
香港・ドル	-	-	-	-	40,164,133	-	40,159,241	4,892
買建	67,696,703	-	67,570,308	△126,395	456,377,003	-	455,713,254	△663,749
アメリカ・ドル	67,696,703	-	67,570,308	△126,395	349,889,703	-	349,237,919	△651,784
イギリス・ポンド	-	-	-	-	69,135,760	-	69,131,186	△4,574
ユーロ	-	-	-	-	37,351,540	-	37,344,149	△7,391
合計	135,393,406	-	135,240,536	△99,920	912,754,006	-	912,034,956	△608,448

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
1口当たり純資産額	3.5133円	3.5024円
（1万口当たり純資産額）	(35,133円)	(35,024円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	SIMON PROPERTY GROUP INC	205,817	21,917,452.330	
		EQUINIX INC	20,670	15,053,134.200	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	372,194	6,513,395.000	
		KIMCO REALTY CORP	428,228	7,776,620.480	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	566,327	11,088,682.660	
		INVITATION HOMES INC	777,356	26,468,971.800	
		AMERICOLD REALTY TRUST	354,365	10,765,608.700	
		VICI PROPERTIES INC	141,974	4,678,043.300	
		APARTMENT INCOME REIT CO	137,832	4,917,845.760	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	45,227	2,519,596.170	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	13,162,156	5,659,727.080	
		IRON MOUNTAIN INC	26,673	1,487,819.940	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	141,690	5,464,983.300	
		SUN COMMUNITIES INC	67,463	9,054,209.230	
		PROLOGIS INC	259,732	32,705,453.440	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	105,290	11,641,915.300	

	COUSINS PROPERTIES INC	194,352	4,023,086.400	
	SITE CENTERS CORP	126,095	1,482,877.200	
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	116,311	6,227,290.940	
	WELLTOWER INC	398,658	31,222,894.560	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	109,582	2,380,121.040	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	103,115	15,549,742.000	
	REALTY INCOME CORP	378,906	23,575,531.320	
	PUBLIC STORAGE	33,508	10,028,609.320	
	UDR INC	281,592	11,474,874.000	
	WP CAREY INC	20,833	1,505,809.240	
	AGREE REALTY CORP	44,816	3,004,464.640	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	271,062	26,187,299.820	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	66,616	10,420,740.880	
アメリカ・ドル 小計			324,796,800.050 (43,896,287,527)	
イギリス・ポンド	LXI REIT PLC	5,034,656	5,105,141.180	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,740,264	2,345,875.870	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	984,701	6,347,382.640	
	SEGRO PLC	1,695,697	13,680,883.390	
	UNITE GROUP PLC/THE	313,404	2,847,275.340	
	BRITISH LAND CO PLC	1,843,937	7,134,192.250	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	799,889	4,051,437.780	
	WORKSPACE GROUP PLC	274,534	1,304,036.500	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	781,775	7,333,049.500	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	747,301	1,389,232.550	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,795,952	4,079,293.960	
イギリス・ポンド 小計			55,617,800.960 (9,491,177,734)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	1,607,351	12,778,440.450	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	6,194,307	8,362,314.450	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,075,846	12,588,098.080	
	MIRVAC GROUP	4,998,874	11,647,376.420	
	STOCKLAND	4,163,376	18,485,389.440	
	GOODMAN GROUP	2,466,295	48,881,966.900	
	CHARTER HALL GROUP	1,924,233	20,839,443.390	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,645,714	15,785,941.620	

オーストラリア・ドル 小計			149,368,970.750 (13,652,323,926)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	90,177	4,453,842.030	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	857,027	17,320,515.670	
カナダ・ドル 小計			21,774,357.700 (2,198,992,384)	
シンガポール・ドル	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	9,954,000	13,039,740.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,638,600	4,702,782.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	3,512,500	7,235,750.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	8,397,600	8,901,456.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	584,200	1,273,556.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,552,877	21,211,990.140	
シンガポール・ドル 小計			56,365,274.140 (5,742,494,130)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,945,596	10,583,575.440	
ニュージーランド・ドル 小計			10,583,575.440 (906,271,564)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	203,725	4,298,597.500	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	157,737	7,143,908.730	
	NSI NV	42,881	872,628.350	
	ICADE	99,165	4,006,266.000	
	KLEPIERRE	469,406	10,115,699.300	
	COVIVIO	84,204	4,068,737.280	
	MERCIALYS	321,418	2,571,344.000	
	COFINIMMO	86,873	7,349,455.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	253,073	6,620,389.680	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	950,851	7,169,416.540	
ユーロ 小計			54,216,443.180 (8,036,503,373)	
香港・ドル	LINK REIT	3,476,292	176,074,189.800	
香港・ドル 小計			176,074,189.800 (3,035,519,032)	
投資証券 合計			86,959,569,670 [86,959,569,670]	

合計		86,959,569,670 [86,959,569,670]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	29銘柄	100%	50.6%
イギリス・ポンド	投資証券	11銘柄	100%	10.9%
オーストラリア・ドル	投資証券	8銘柄	100%	15.7%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	100%	2.5%
シンガポール・ドル	投資証券	6銘柄	100%	6.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	100%	1.0%
ユーロ	投資証券	10銘柄	100%	9.2%
香港・ドル	投資証券	1銘柄	100%	3.5%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月10日現在 金 額（円）	2023年5月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	905,292,879	1,181,800,702
株式	15,412,824,160	18,568,531,650
派生商品評価勘定	-	14,313,450

未収入金	9,005,943	3,571,279
未収配当金	201,109,890	263,868,050
差入委託証拠金	-	17,325,000
流動資産合計	16,528,232,872	20,049,410,131
資産合計	16,528,232,872	20,049,410,131
負債の部		
流動負債		
前受金	-	16,635,000
未払金	31,918,161	70,595,356
未払解約金	6,076,000	2,308,000
流動負債合計	37,994,161	89,538,356
負債合計	37,994,161	89,538,356
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,552,281,685	4,996,559,322
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,937,957,026	14,963,312,453
元本等合計	16,490,238,711	19,959,871,775
純資産合計	16,490,238,711	19,959,871,775
負債純資産合計	16,528,232,872	20,049,410,131

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11月11日 至2023年5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、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11月10日現在	2023年5月10日現在
1. ※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	4,567,462,791円	4,552,281,685円
期中追加設定元本額	182,891,209円	620,031,016円
期中一部解約元本額	198,072,315円	175,753,379円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	2,609,444,757円	3,113,531,797円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	22,480,704円	20,761,346円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,031,031円	19,566,691円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,497,466円	14,911,312円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	288,440,067円	269,222,418円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	45,736,859円	42,778,445円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	48,192,825円	43,623,662円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	224,232,533円	219,391,291円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	439,550,258円	427,418,426円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	838,675,185円	825,353,934円

計	4,552,281,685円	4,996,559,322円
2. 期末日における受益権の総数	4,552,281,685口	4,996,559,322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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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5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11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	378,882,075	727,497,016
合計	378,882,075	727,497,016

（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11月10日現在				2023年5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	-	-	-	-	424,050,000	-	438,375,000	14,325,000
合計	-	-	-	-	424,050,000	-	438,375,000	14,325,000

（注）　1．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
１口当たり純資産額	3.6224円	3.9947円
（1万口当たり純資産額）	(36,224円)	(39,947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	
ＩＮＰＥＸ	102,700	1,458.00	149,736,600	
オリエンタル白石	301,200	333.00	100,299,600	
大成建設	12,100	4,780.00	57,838,000	
九電工	32,400	3,585.00	116,154,000	
ブルボン	22,400	2,123.00	47,555,200	
アサヒグループホールディン	55,000	5,237.00	288,035,000	
日清オイリオグループ	35,000	3,390.00	118,650,000	
エレマテック	22,200	1,878.00	41,691,600	
パルグループＨＬＤＧＳ	65,500	3,175.00	207,962,500	
太陽化学	22,300	1,472.00	32,825,600	
グ　ン　ゼ	16,200	4,640.00	75,168,000	
ダイワボウＨＤ	158,300	2,646.00	418,861,800	
トヨタ紡織	106,700	2,144.00	228,764,800	
レスターホールディングス	11,400	2,199.00	25,068,600	
三洋貿易	79,700	1,309.00	104,327,300	
オープンハウスグループ	11,200	5,700.00	63,840,000	
東急不動産ＨＤ	95,900	679.00	65,116,100	
東　レ	250,000	761.10	190,275,000	
ＡＮＤ　ＤＯホールディングス	46,800	1,051.00	49,186,800	
共和レザー	65,900	544.00	35,849,600	
セーレン	24,600	2,295.00	56,457,000	
レンゴー	212,800	875.00	186,200,000	
日本曹達	41,700	4,835.00	201,619,500	
東亞合成	72,200	1,223.00	88,300,600	
大阪ソーダ	31,800	4,390.00	139,602,000	
信越化学	84,000	3,973.00	333,732,000	
東京応化工業	11,200	7,350.00	82,320,000	
住友ベークライト	26,800	5,120.00	137,216,000	

旭有機材	25,800	3,255.00	83,979,000	
アステラス製薬	194,100	2,095.50	406,736,550	
日本空調サービス	76,300	737.00	56,233,100	
大塚商会	7,800	5,060.00	39,468,000	
フルキャストホールディングス	35,300	2,423.00	85,531,900	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	45,600	7,234.00	329,870,400	
デクセリアルズ	56,900	2,628.00	149,533,200	
ＡＧＣ	114,200	5,190.00	592,698,000	
日本製鉄	39,800	2,825.00	112,435,000	
大和工業	17,200	5,520.00	94,944,000	
大同特殊鋼	18,300	5,220.00	95,526,000	
大紀アルミニウム	37,900	1,416.00	53,666,400	
ＵＡＣＪ	13,700	2,755.00	37,743,500	
住友電工	255,200	1,749.00	446,344,800	
ＳＷＣＣ	57,400	1,786.00	102,516,400	
リョービ	25,200	1,587.00	39,992,400	
日東精工	77,400	613.00	47,446,200	
マルゼン	30,900	2,149.00	66,404,100	
ファインシンター	17,800	1,023.00	18,209,400	
ツ　ガ　ミ	131,100	1,451.00	190,226,100	
オーエスジー	27,300	1,945.00	53,098,500	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	68,400	1,427.00	97,606,800	
フリュー	49,100	1,159.00	56,906,900	
小松製作所	119,400	3,338.00	398,557,200	
日　立	77,500	7,803.00	604,732,500	
富士電機	51,500	5,690.00	293,035,000	
ダイヘン	11,900	4,605.00	54,799,500	
ＩＤＥＣ	61,500	3,460.00	212,790,000	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	63,600	4,875.00	310,050,000	
デンソー	37,200	8,170.00	303,924,000	
ＩＨＩ	74,300	3,510.00	260,793,000	
プレミアグループ	68,100	1,622.00	110,458,200	
いすゞ自動車	189,000	1,631.00	308,259,000	
トヨタ自動車	448,500	1,931.50	866,277,750	
プレス工業	130,900	545.00	71,340,500	
豊田合成	17,200	2,335.00	40,162,000	
ポピンズ	10,400	1,762.00	18,324,800	
第一興商	29,900	2,485.00	74,301,500	
萩原電気ＨＬＤＧＳ	17,700	3,555.00	62,923,500	
ダイトロン	43,500	2,669.00	116,101,500	

大日本印刷	30,100	3,935.00	118,443,500	
信越ポリマー	69,600	1,355.00	94,308,000	
伊　藤　忠	96,400	4,671.00	450,284,400	
東京エレクトロン	30,700	15,630.00	479,841,000	
スターゼン	20,800	2,356.00	49,004,800	
セイコーグループ	39,800	2,741.00	109,091,800	
ＢＩＰＲＯＧＹ	127,300	3,600.00	458,280,000	
三菱商事	76,200	5,342.00	407,060,400	
阪和興業	28,300	4,345.00	122,963,500	
丸井グループ	80,300	2,496.00	200,428,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	656,000	863.00	566,128,000	
三井住友トラストＨＤ	79,400	5,018.00	398,429,200	
三井住友フィナンシャルＧ	36,600	5,678.00	207,814,800	
ＳＢＩホールディングス	9,500	2,662.00	25,289,000	
ＭＳ＆ＡＤ	55,500	4,550.00	252,525,000	
東京海上ＨＤ	285,300	2,756.50	786,429,450	
三井不動産	57,900	2,667.00	154,419,300	
東京建物	40,700	1,701.00	69,230,700	
九州旅客鉄道	121,300	3,090.00	374,817,000	
三井倉庫ＨＯＬＤ	31,600	4,075.00	128,770,000	
日本管財ホールディンク	6,000	2,672.00	16,032,000	
上　組	129,500	3,030.00	392,385,000	
日本電信電話	161,700	4,190.00	677,523,000	
ＫＤＤＩ	62,400	4,221.00	263,390,400	
光通信	11,400	18,450.00	210,330,000	
関西電力	158,800	1,482.00	235,341,600	
大阪瓦斯	139,400	2,248.00	313,371,200	
合計			18,568,531,650	

(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。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	244,741,896	399,493,589
コール・ローン	10,680,021	51,724,284
株式	3,439,881,488	3,503,785,672
優先出資証券	953,465,166	838,902,055
投資証券	31,907,099	55,559,612
未収入金	430,418	-
未収配当金	3,986,507	2,757,110
未収利息	2,123,260	2,228,783
流動資産合計	4,687,215,855	4,854,451,105
資産合計	4,687,215,855	4,854,451,105
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	16,426,000
流動負債合計	-	16,426,000
負債合計	-	16,426,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	1,007,515,090	1,050,560,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,679,700,765	3,787,464,480
元本等合計	4,687,215,855	4,838,025,105
純資産合計	4,687,215,855	4,838,025,105
負債純資産合計	4,687,215,855	4,854,451,105

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11月11日 至2023年5月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)優先出資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産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．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)受取利息 優先出資証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。
4.　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11月10日現在	2023年5月10日現在
1.　※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	980,375,949円	1,007,515,090円
期中追加設定元本額	53,537,523円	68,906,968円
期中一部解約元本額	26,398,382円	25,861,433円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,873,667円	5,337,594円

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,133,835円	3,915,157円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	72,782,482円	74,120,793円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	11,512,873円	11,512,873円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	12,235,237円	11,813,452円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	134,636,516円	140,744,884円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	264,196,886円	273,712,689円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	503,143,594円	529,403,183円
計	1,007,515,090円	1,050,560,625円
2. 期末日における受益権の総数	1,007,515,090口	1,050,560,625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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年5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	2022年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	179,476,543	△18,995,031
優先出資証券	△2,426,203	△28,705,490
投資証券	△1,374,288	△818,713
合計	175,676,052	△48,519,234

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.6523円 (46,523円)	4.6052円 (46,052円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	ABBOTT LABORATORIES	2,040	110.250	224,910.000	
	ADOBE INC	843	342.650	288,853.950	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,881	67.790	127,512.990	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	768	279.940	214,993.920	
	CITIGROUP INC	5,075	46.520	236,089.000	
	DANAHER CORP	954	235.160	224,342.640	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,525	106.210	374,390.250	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,727	75.020	129,559.540	
	APPLE INC	11,002	171.770	1,889,813.540	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,467	41.540	144,019.180	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,093	37.570	191,344.010	
	JPMORGAN CHASE & CO	3,077	136.410	419,733.570	
	SERVICENOW INC	608	441.390	268,365.120	
	CATERPILLAR INC	781	213.490	166,735.690	
	MORGAN STANLEY	3,553	84.370	299,766.610	
	BROADCOM INC	1,541	618.510	953,123.910	
	DEERE & CO	834	381.440	318,120.960	
	TELEFLEX INC	971	251.990	244,682.290	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	2,760	80.640	222,566.400	
	COSTCO WHOLESALE CORP	697	500.790	349,050.630	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,231	132.910	163,612.210	
	CSX CORP	8,377	32.020	268,231.540	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,117	222.780	248,845.260	
	AMAZON.COM INC	6,283	106.620	669,893.460	
	EXXON MOBIL CORP	1,992	109.140	217,406.880	
	FORD MOTOR CO	10,276	11.860	121,873.360	
	NEXTERA ENERGY INC	2,871	75.580	216,990.180	
	GENERAL MOTORS CO	3,982	33.280	132,520.960	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,164	324.770	378,032.280	
	ALPHABET INC-CL A	7,130	107.350	765,405.500	
	HOME DEPOT INC	839	290.580	243,796.620	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,033	121.170	246,338.610	
	JOHNSON & JOHNSON	3,056	161.050	492,168.800	
	KLA CORP	859	375.750	322,769.250	

MCDONALD'S CORP	1,872	296.660	555,347.520	
META PLATFORMS INC CLASS A	3,279	233.370	765,220.230	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	767	286.570	219,799.190	
BAKER HUGHES CO	11,817	28.190	333,121.230	
MERCK & CO. INC.	2,148	117.430	252,239.640	
NIKE INC -CL B	3,406	125.100	426,090.600	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,630	95.650	251,559.500	
EVERGY INC	3,649	62.160	226,821.840	
PFIZER INC	2,215	38.480	85,233.200	
XCEL ENERGY INC	2,438	69.110	168,490.180	
DOW INC	2,377	53.670	127,573.590	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,213	153.710	493,870.230	
PEPSICO INC	1,414	194.140	274,513.960	
CHEVRON CORP	717	159.120	114,089.040	
TESLA INC	1,608	169.150	271,993.200	
AT&T INC	19,060	17.020	324,401.200	
UNION PACIFIC CORP	1,238	200.590	248,330.420	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,194	173.010	379,583.940	
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,027	490.380	503,620.260	
ELEVANCE HEALTH INC	784	460.480	361,016.320	
WALT DISNEY CO/THE	3,022	102.180	308,787.960	
WASTE MANAGEMENT INC	2,093	169.460	354,679.780	
WALMART INC	1,403	152.980	214,630.940	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,403	228.870	321,104.610	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,552	233.260	362,019.520	
PPL CORP	2,937	28.540	83,821.980	
NVIDIA CORP	1,553	285.710	443,707.630	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	626	534.660	334,697.160	
MASTERCARD INC - A	924	382.940	353,836.560	
ONEOK INC	1,273	63.860	81,293.780	
BANK OF AMERICA CORP	14,012	27.660	387,571.920	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,993	95.060	189,454.580	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,632	99.820	162,906.240	
EATON CORP PLC	2,521	170.550	429,956.550	
BARRICK GOLD CORP	10,309	19.780	203,912.020	
CARDINAL HEALTH INC	4,181	84.350	352,667.350	
TARGET CORP	1,253	157.420	197,247.260	
MICROSOFT CORP	6,173	307.000	1,895,111.000	
MEDTRONIC PLC	3,262	89.600	292,275.200	

	CHUBB LTD	992	201.480	199,868.160	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	8,194	15.040	123,237.760	
	COMCAST CORP-CLASS A	4,333	39.620	171,673.460	
アメリカ・ドル 小計				25,623,235.820 (3,462,980,321)	
カナダ・ドル	SUNCOR ENERGY INC	5,153	39.680	204,471.040	
	ENBRIDGE INC	3,741	53.350	199,582.350	
カナダ・ドル 小計				404,053.390 (40,805,351)	
合計				3,503,785,672 [3,503,785,672]	

(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
優先出資証券	アメリカ・ドル	MORGAN STANLEY 5.85 K	1,933	45,000.240	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6,877	146,961.490	
		BANK OF AMERICA CORP 6 GG	6,887	169,351.330	
		RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75 F	4,535	104,350.350	
		BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	4,965	120,718.510	
		JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	4,796	117,454.040	
		NISOURCE INC 6.5 B	2,810	70,109.500	
		JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	5,388	135,184.920	
		CMS ENERGY CORP 5.875	12,484	304,484.760	
		REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	5,264	94,225.600	
		ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.219-A	9,830	227,073.000	
		ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100	21,769.000	
		BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	9,586	216,739.460	
		ALLSTATE CORP 5.1 H	3,069	72,305.640	
		SEMPRA ENERGY 5.75	6,407	157,099.640	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.125	5,804	121,884.000	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.1	7,283	154,035.450	

		SOUTHERN CO 4.95 2020	3,781	86,622.710	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	13,547	254,141.720	
		ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	5,492	120,549.400	
		TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	328	6,068.000	
		UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1,403	19,964.690	
		BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167	47,163.910	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	13,524	251,140.680	
		BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN	4,493	82,940.780	
		BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	12,288	214,605.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	13,615	233,769.550	
		WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	4,812	63,999.600	
		FIRST HORIZON CORP 6.1 D	2,156	39,433.240	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12,600	254,898.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	8,403	171,253.140	
		KEMPER CORP FR	888	15,415.680	
		WESCO INTERNATIONAL INC FR	5,224	141,674.880	
		WTFNL FR	1,744	35,141.600	
		MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	2,704	69,060.160	
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	1,269	32,156.460	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	7,202	143,607.880	
		RGA FR	12,175	312,167.000	
		AQNCN FR	703	16,302.570	
		LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4,900	122,500.000	
		ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I	3,250	76,700.000	

		WR BERKLEY CORPORATION 4.125	4,917	85,555.800	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J	6,027	150,675.000	
		CITIGROUP INC 6.875 K	4,118	102,085.220	
		FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	4,782	114,911.460	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589	39,725.000	
		REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	2,500	52,000.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	4,822	119,331.960	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	673	16,427.930	
		ALLSTATE CORP FR	1,591	40,228.430	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	5,449	134,753.770	
		STATE STREET CORP 5.9 D	7,689	177,692.790	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3,258	76,986.540	
		CITIGROUP INC 7.125 J	269	6,794.940	
	アメリカ・ドル 小計			6,207,192.420 (838,902,055)	
優先出資証券 合計				838,902,055 [838,902,055]	
投資証券	アメリカ・ドル	DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7,569	142,599.960	
		PUBLIC STORAGE 4.625 L	8,468	183,416.880	
		AGREE RLTY DEPOSITARY SHS 4.25	4,761	85,079.070	
	アメリカ・ドル 小計			411,095.910 (55,559,612)	
投資証券 合計				55,559,612 [55,559,612]	
合計				894,461,667 [894,461,667]	

優先出資証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入優先出資証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 76銘柄 優先出資証券 54銘柄 投資証券 3銘柄	79.4%	19.3%	1.3%	99.1%
カナダ・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	-%	0.9%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月10日現在 金 額（円）	2023年5月10日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	76,078,756	46,296,669
コール・ローン	7,783,437	22,003,391
株式	1,483,405,340	1,627,723,046
未収配当金	598,019	9,697,905
流動資産合計	1,567,865,552	1,705,721,011
資産合計	1,567,865,552	1,705,721,011
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,050	-
未払解約金	6,763,000	2,654,000
流動負債合計	6,778,050	2,654,000
負債合計	6,778,050	2,654,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	696,293,431	669,652,712

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	864,794,071	1,033,414,299
元本等合計	1,561,087,502	1,703,067,011
純資産合計	1,561,087,502	1,703,067,011
負債純資産合計	1,567,865,552	1,705,721,011

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11月11日 至2023年5月10日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．　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11月10日現在	2023年5月10日現在
1. ※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	677,515,208円	696,293,431円
期中追加設定元本額	46,716,256円	31,611,424円
期中一部解約元本額	27,938,033円	58,252,143円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,114,010円	10,162,732円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,096,018円	7,797,716円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	159,502,392円	140,714,429円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	25,272,380円	23,196,928円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	25,762,466円	21,941,919円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	69,170,453円	69,622,528円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	137,079,783円	135,040,732円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	260,295,929円	261,175,728円
計	696,293,431円	669,652,712円
2. 期末日における受益権の総数	696,293,431口	669,652,712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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年5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	2022年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	111,971,885	12,211,841
合計	111,971,885	12,211,841

（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11月10日現在				2023年5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)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	14,648,200	-	14,663,250	△15,050	-	-	-	-
ユーロ	14,648,200	-	14,663,250	△15,050	-	-	-	-
合計	14,648,200	-	14,663,250	△15,050	-	-	-	-

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
１口当たり純資産額	2.2420円	2.5432円
（1万口当たり純資産額）	(22,420円)	(25,432円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	12,408	23.780	295,062.240	
	UNILEVER PLC	4,736	43.685	206,892.160	
	PRUDENTIAL PLC	15,660	11.745	183,926.700	
	AVIVA PLC	32,608	4.140	134,997.120	
	GSK	13,419	14.462	194,065.570	
	M&G PLC	72,546	1.993	144,584.170	
	TESCO PLC	93,308	2.846	265,554.560	
	VODAFONE GROUP PLC	107,247	0.942	101,112.470	
	NATIONAL GRID PLC	18,856	11.530	217,409.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	45,791	5.993	274,425.460	
イギリス・ポンド 小計				2,018,030.130 (344,376,841)	
スイス・フラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,385	283.600	392,786.000	
	NESTLE SA-REG	5,885	116.420	685,131.700	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	953	432.500	412,172.500	
	NOVARTIS AG-REG	4,630	93.460	432,719.800	
	GIVAUDAN-REG	81	3,116.000	252,396.000	
スイス・フラン 小計				2,175,206.000 (330,348,535)	
スウェーデン・クローナ	ELECTROLUX AB-SER B	2,623	164.750	432,139.250	
スウェーデン・クローナ 小計				432,139.250 (5,730,167)	
ユーロ	SIEMENS AG-REG	2,954	150.640	444,990.560	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,161	108.720	343,663.920	

	BASF SE	3,878	46.845	181,664.910	
	ALLIANZ SE-REG	1,208	215.900	260,807.200	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,094	335.800	367,365.200	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	22,308	21.385	477,056.580	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,287	42.040	264,305.480	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,864	31.805	218,309.520	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,845	114.650	211,529.250	
	KONINKLIJKE KPN NV	92,764	3.330	308,904.120	
	TOTALENERGIES SE	6,645	55.450	368,465.250	
	MICHELIN (CGDE)	9,094	29.370	267,090.780	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,865	155.400	445,221.000	
	BNP PARIBAS	4,209	58.420	245,889.780	
	CAPGEMINI SE	1,845	162.000	298,890.000	
	AXA SA	12,793	27.545	352,383.180	
	SANOFI	4,107	100.840	414,149.880	
	INTESA SANPAOLO	106,084	2.456	260,595.340	
	ENI SPA	13,646	13.520	184,493.920	
	ENEL SPA	50,801	6.112	310,495.710	
	ENAGAS SA	9,015	18.220	164,253.300	
ユーロ 小計				6,390,524.880 (947,267,503)	
合計				1,627,723,046 [1,627,723,046]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	21.2%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	20.3%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	100%	0.4%
ユーロ	株式 21銘柄	100%	58.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	34,283,208	12,848,546
コール・ローン	5,183,332	4,919,695
株式	677,644,408	682,908,244
未収配当金	811,745	2,143,146
流動資産合計	717,922,693	702,819,631
資産合計	717,922,693	702,819,631
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,809,000	661,000
流動負債合計	2,809,000	661,000
負債合計	2,809,000	661,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	245,446,403	234,986,530
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	469,667,290	467,172,101
元本等合計	715,113,693	702,158,631
純資産合計	715,113,693	702,158,631
負債純資産合計	717,922,693	702,819,631

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11月11日 至2023年5月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．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11月10日現在	2023年5月10日現在
1.　※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	232,903,188円	245,446,403円
期中追加設定元本額	18,931,614円	9,867,502円
期中一部解約元本額	6,388,399円	20,327,375円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,897,395円	8,239,994円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,163,917円	6,147,132円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	121,568,958円	113,513,571円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	19,413,482円	18,394,443円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	19,992,659円	18,300,661円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	10,266,521円	10,468,636円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	20,454,163円	20,399,434円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	38,689,308円	39,522,659円
計	245,446,403円	234,986,530円
2.　期末日における受益権の総数	245,446,403口	234,986,530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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年5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	2022年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	25,101,464	△11,558,277
合計	25,101,464	△11,558,277

（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11月10日現在	2023年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9135円 (29,135円)	2.9881円 (29,881円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	7,300	24.000	175,200.000	
	BHP GROUP LTD	9,950	44.470	442,476.500	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4,478	33.970	152,117.660	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,700	20.580	96,726.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,200	27.360	196,992.000	
	WESTPAC BANKING CORP	8,300	21.770	180,691.000	
	RIO TINTO LTD	1,200	111.440	133,728.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	10,400	8.430	87,672.000	
	SEEK LTD	3,400	23.460	79,764.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,200	97.340	311,488.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	920	177.430	163,235.600	
	CSL LTD	1,020	299.820	305,816.400	
	WESFARMERS LTD	4,330	51.350	222,345.500	
	MINERAL RESOURCES LTD	800	73.500	58,800.000	
オーストラリア・ドル 小計				2,607,052.660 (238,284,613)	
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,800	31.700	152,160.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,500	12.250	116,375.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	69,600	2.580	179,568.000	
シンガポール・ドル 小計				448,103.000 (45,652,733)	
韓国・ウォン	KIA CORP	1,150	87,600.000	100,740,000.000	

	SK HYNIX INC	1,100	87,300.000	96,030,000.000	
	LG CORP	1,200	90,100.000	108,120,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,300	11,820.000	86,286,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	800	118,600.000	94,880,000.000	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7,700	10,120.000	77,924,000.000	
	KT&G CORP	1,300	85,600.000	111,280,000.000	
	LG CHEM LTD	100	722,000.000	72,200,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,260	65,300.000	539,378,000.000	
韓国・ウォン 小計				1,286,838,000.000 (131,386,161)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	10,000	46.100	461,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,000	107.700	646,200.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,000	316.000	948,000.000	
	AIA GROUP LTD	24,600	80.900	1,990,140.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	15,000	13.360	200,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	2,500	83.550	208,875.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	21,500	24.950	536,425.000	
香港・ドル 小計				4,991,040.000 (86,045,529)	
台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	86,000	44.450	3,822,700.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	20,000	104.500	2,090,000.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	8,000	304.000	2,432,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	31,000	91.800	2,845,800.000	
	MEDIATEK INC	4,000	677.000	2,708,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	417.000	1,668,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	8,000	160.500	1,284,000.000	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	287.500	1,150,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	27,000	510.000	13,770,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	40,000	106.500	4,260,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	292.000	2,336,000.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	58,000	49.950	2,897,100.000	
台湾・ドル 小計				41,263,600.000 (181,539,208)	
合計				682,908,244 [682,908,244]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
オーストラリア・ドル	株式	14銘柄	100%	34.9%
シンガポール・ドル	株式	3銘柄	100%	6.7%
韓国・ウォン	株式	9銘柄	100%	19.2%
香港・ドル	株式	7銘柄	100%	12.6%
台湾・ドル	株式	12銘柄	100%	26.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2022年11月10日現在 金　額（円）	2023年5月10日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,446,143,083	2,303,405,424
投資証券	※2	140,686,276,400	139,781,494,500
派生商品評価勘定		-	54,137,470
未収入金		1,019,649,027	308,589,538
未収配当金		1,377,214,250	1,412,902,063
前払金		83,160,000	-
流動資産合計		145,612,442,760	143,860,528,995
資産合計		145,612,442,760	143,860,528,995
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		85,692,000	-
前受金		-	71,871,300

未払金	881,064,834	274,156,321
未払解約金	9,338,000	9,857,000
流動負債合計	976,094,834	355,884,621
負債合計	976,094,834	355,884,621
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	41,557,096,335	41,918,129,534
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	103,079,251,591	101,586,514,840
元本等合計	144,636,347,926	143,504,644,374
純資産合計	144,636,347,926	143,504,644,374
負債純資産合計	145,612,442,760	143,860,528,995

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11月11日 至2023年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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、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11月10日現在	2023年5月10日現在
1. ※1 期首	2022年5月11日	2022年11月11日
期首元本額	39,918,696,415円	41,557,096,335円
期中追加設定元本額	2,240,368,194円	2,550,233,280円
期中一部解約元本額	601,968,274円	2,189,200,081円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	38,686,979,949円	38,873,755,040円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,693,026円	11,178,226円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,333,819円	8,637,531円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	41,127,418円	42,312,391円
６資産バランスファンド（分配型）	76,983,197円	75,286,260円
６資産バランスファンド（成長型）	214,916,634円	218,634,736円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	21,416,625円	21,134,370円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	24,472,294円	24,496,760円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	344,438,177円	378,575,561円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	447,825,965円	490,237,338円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	683,355,898円	758,043,409円
ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	252,387,244円	246,902,119円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	53,281,917円	52,747,687円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	18,604,861円	18,612,725円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	91,575,837円	90,988,033円

	ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年4回決算型）	581,703,474円	606,587,348円
	計	41,557,096,335円	41,918,129,534円
2.	期末日における受益権の総数	41,557,096,335口	41,918,129,534口
3.	※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,051,400,000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。 投資証券　916,600,000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11月11日 至2023年5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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年5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11月10日現在	2023年5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△2,025,880,823	△4,355,903,488
合計	△2,025,880,823	△4,355,903,488

（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を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2022年11月10日現在				2023年5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								
不動産投信指数先物取引								
買建	2,414,160,000	-	2,328,600,000	△85,560,000	2,368,647,700	-	2,422,928,500	54,280,800
合計	2,414,160,000	-	2,328,600,000	△85,560,000	2,368,647,700	-	2,422,928,500	54,280,800

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月10日現在	2023年5月10日現在
１口当たり純資産額	3.4804円	3.4235円
（1万口当たり純資産額）	(34,804円)	(34,235円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	サンケイリアルエステート	11,119	932,884,100	
	S0SILA物流リート投	3,652	495,941,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	7,763	5,077,002,000	
	森ヒルズリート	9,144	1,382,572,800	
	産業ファンド	19,106	2,936,592,200	
	アドバンス・レジデンス	12,897	4,546,192,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	24,800	5,235,280,000	
	ＡＰＩ投資法人	6,044	2,384,358,000	
	ＧＬＰ投資法人	54,348	8,293,504,800	
	コンフォリア・レジデンシャル	8,536	2,893,704,000	
	日本プロロジスリート	29,501	9,174,811,000	
	星野リゾート・リート	192	137,856,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,739	890,629,800	
	イオンリート投資	21,441	3,342,651,900	
	ヒューリックリート投資法	15,930	2,454,813,000	

	日本リート投資法人	8,818	2,848,214,000	
	積水ハウス・リート投資	36,480	2,849,088,000	
	ケネディクス商業リート	13,290	3,230,799,000	
	野村不動産マスターF	42,451	6,770,934,500	
	ラサールロジポート投資	20,661	3,373,941,300	
	スターアジア不動産投	8,582	483,166,600	
	三井不ロジパーク	6,101	3,172,520,000	
	三菱地所物流REIT	11,654	4,906,334,000	
	CREロジスティクスファンド	5,118	954,507,000	
	ザイマックス・リート	5,702	623,798,800	
	タカラレーベン不動産投	5,237	479,709,200	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,461	202,786,800	
	日本ビルファンド	19,691	10,790,668,000	※
	ジャパンリアルエステイト	7,110	3,789,630,000	※
	日本都市ファンド投資法人	64,387	6,393,629,100	
	オリックス不動産投資	23,573	4,179,492,900	
	日本プライムリアルティ	11,975	4,149,337,500	
	NTT都市開発リート投資法人	12,395	1,610,110,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	396	41,144,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	33,045	4,946,836,500	
	インヴィンシブル投資法人	43,438	2,497,685,000	
	フロンティア不動産投資	3,388	1,638,098,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	3,485	1,115,200,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	15,530	4,682,295,000	
	大和証券オフィス投資法人	2,680	1,562,440,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,635	677,173,500	
	大和ハウスリート投資法人	25,769	7,555,470,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	45,899	3,570,942,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	4,361	506,748,200	
投資証券　合計			139,781,494,500	
合計			139,781,494,500	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　700口

ジャパンリアルエステイト　1,000口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(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か月未満であるため、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、当特定期間(2022年11月11日から2023年5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】

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,264,492	7,704,244
親投資信託受益証券	597,654,980	593,025,994
流動資産合計	605,919,472	600,730,238
資産合計	605,919,472	600,730,238
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	958,017	947,423
未払受託者報酬	53,451	53,724
未払委託者報酬	1,309,940	1,316,623
その他未払費用	25,195	24,012
流動負債合計	2,346,603	2,341,782
負債合計	2,346,603	2,341,782
純資産の部		
元本等		
元本	※1 638,678,367	※1 631,615,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 35,105,498	※2 △ 33,227,244
（分配準備積立金）	22,951,322	24,320,997
元本等合計	603,572,869	598,388,456
純資産合計	603,572,869	598,388,456
負債純資産合計	605,919,472	600,730,238

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2022年5月11日 至　2022年11月10日	当期 自　2022年11月11日 至　2023年5月10日
営業収益		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	14,162,904	8,371,014
営業収益合計	14,162,904	8,371,016
営業費用		
支払利息	1,065	1,158
受託者報酬	168,588	160,644
委託者報酬	※1 4,131,679	※1 3,936,955
その他費用	25,195	24,012
営業費用合計	4,326,527	4,122,769
営業利益	9,836,377	4,248,247
経常利益	9,836,377	4,248,247
当期純利益	9,836,377	4,248,247
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（△）	△ 265,010	133,355
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 42,913,689	△ 35,105,498
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,143,936	2,103,821
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,143,936	2,103,821
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,559,720	1,482,183
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,559,720	1,482,183
分配金	※2 2,877,412	※2 2,858,276
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 35,105,498	△ 33,227,244

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
1. ※1 期首元本額	650,186,865円	638,678,367円
期中追加設定元本額	32,754,614円	20,401,505円
期中一部解約元本額	44,263,112円	27,464,172円
2. 特定期間末日における受益権の総数	638,678,367口	631,615,700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35,105,498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33,227,244円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期 自2022年5月11日 至2022年11月10日	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	170,300円	164,248円

2．　※2 分配金の計算過程	(自2022年5月11日至2022年7月11日) 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（2,195,167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（2,459,451円）及び分配準備積立金（21,221,106円）より分配対象額は25,875,724円（1万口当たり406.59円）であり、うち954,609円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 (自2022年7月12日至2022年9月12日) 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（2,263,793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（3,273,383円）及び分配準備積立金（21,941,091円）より分配対象額は27,478,267円（1万口当たり427.22円）であり、うち964,786円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	(自2022年11月11日至2023年1月10日) 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（869,583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（4,084,225円）及び分配準備積立金（22,610,075円）より分配対象額は27,563,883円（1万口当たり429.18円）であり、うち963,365円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 (自2023年1月11日至2023年3月10日) 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（1,631,499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（4,212,965円）及び分配準備積立金（21,953,837円）より分配対象額は27,798,301円（1万口当たり440.08円）であり、うち947,488円（1万口当たり15円）を分配金額としております。

	(自2022年9月13日至2022年11月10日) 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（1,154,842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（3,582,636円）及び分配準備積立金（22,754,497円）より分配対象額は27,491,975円（1万口当たり430.45円）であり、うち958,017円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	(自2023年3月11日至2023年5月10日) 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（2,694,952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（4,278,967円）及び分配準備積立金（22,573,468円）より分配対象額は29,547,387円（1万口当たり467.81円）であり、うち947,423円（1万口当たり15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	当期 自2022年11月11日 至2023年5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、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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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	当期 2023年5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	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の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	△15,969,231	22,199,094
合計	△15,969,231	22,199,094

(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

前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5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)

当期 自2022年11月11日 至2023年5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）

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在

１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9450円 (9,450円)	0.9474円 (9,474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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	224,525,112	420,266,104	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	7,821,382	27,393,608	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	14,911,312	59,566,218	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	3,915,157	18,030,081	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	7,797,716	19,831,151	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	6,147,132	18,368,245	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	8,637,531	29,570,587	
親投資信託受益証券 合計			593,025,994	
合計			593,025,994	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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、当ファンドの特定期間末日（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。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(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か月未満であるため、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、当特定期間(2022年11月11日から2023年5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】

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	43,608,525	46,269,896
親投資信託受益証券	2,970,736,946	2,992,377,196
流動資産合計	3,014,345,471	3,038,647,092
資産合計	3,014,345,471	3,038,647,092
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,973,887	14,642,064
未払解約金	761,346	99
未払受託者報酬	264,177	269,001
未払委託者報酬	6,869,111	6,994,256
その他未払費用	125,745	120,229
流動負債合計	19,994,266	22,025,649
負債合計	19,994,266	22,025,649
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,993,471,938	※1 2,928,412,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	879,267	88,208,643
（分配準備積立金）	189,984,652	199,079,179
元本等合計	2,994,351,205	3,016,621,443
純資産合計	2,994,351,205	3,016,621,443
負債純資産合計	3,014,345,471	3,038,647,092

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2022年5月11日 至　2022年11月10日	当期 自　2022年11月11日 至　2023年5月10日
営業収益		
受取利息	3	10
有価証券売買等損益	118,663,831	150,640,250
その他収益	-	91
営業収益合計	118,663,834	150,640,351
営業費用		
支払利息	4,655	4,975
受託者報酬	838,939	802,080
委託者報酬	※1 21,813,688	※1 20,855,047
その他費用	125,745	120,229
営業費用合計	22,783,027	21,782,331
営業利益	95,880,807	128,858,020
経常利益	95,880,807	128,858,020
当期純利益	95,880,807	128,858,020
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（△）	△ 95,518	1,079,535
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 56,189,740	879,267
剰余金増加額又は欠損金減少額	215,437	1,145,135
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	114,369	1,145,135
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	101,068	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	526,424
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	526,424
分配金	※2 39,122,755	※2 41,067,820
期末剰余金又は期末欠損金（△）	879,267	88,208,643

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
1. ※1 期首元本額	3,070,635,843円	2,993,471,938円
期中追加設定元本額	57,102,598円	58,018,990円
期中一部解約元本額	134,266,503円	123,078,128円
2. 特定期間末日における受益権の総数	2,993,471,938口	2,928,412,800口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	前期 自2022年5月11日 至2022年11月10日	当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	2,121,635円	2,040,413円

2．　※2 分配金の計算過程	(自2022年5月11日至2022年7月11日) 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（13,123,271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（25,902,708円）及び分配準備積立金（184,140,951円）より分配対象額は223,166,930円（1万口当たり734.99円）であり、うち12,145,348円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 (自2022年7月12日至2022年9月12日) 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（11,246,586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（15,260,217円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,851,755円）及び分配準備積立金（181,711,394円）より分配対象額は235,069,952円（1万口当たり783.38円）であり、うち15,003,520円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	(自2022年11月11日至2023年1月10日) 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（2,239,204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（29,554,699円）及び分配準備積立金（186,489,264円）より分配対象額は218,283,167円（1万口当たり738.34円）であり、うち11,825,686円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 (自2023年1月11日至2023年3月10日) 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（9,443,051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（29,993,646円）及び分配準備積立金（173,933,035円）より分配対象額は213,369,732円（1万口当たり730.71円）であり、うち14,600,070円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

	(自2022年9月13日至2022年11月10日) 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（11,076,534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（28,746,907円）及び分配準備積立金（190,882,005円）より分配対象額は230,705,446円（1万口当たり770.70円）であり、うち11,973,887円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	(自2023年3月11日至2023年5月10日) 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（22,751,533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（23,233,563円）、投資信託約款に規定される収益調整金（31,703,803円）及び分配準備積立金（167,736,147円）より分配対象額は245,425,046円（1万口当たり838.08円）であり、うち14,642,064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	当期 自2022年11月11日 至2023年5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、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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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	当期 2023年5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	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の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	△56,156,884	88,667,466
合計	△56,156,884	88,667,466

(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

前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5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)

当期 自2022年11月11日 至2023年5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)

	前期 2022年11月10日現在	当期 2023年5月10日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0003円 (10,003円)	1.0301円 (10,301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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	315,634,835	590,805,284	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	40,788,242	142,856,738	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	269,222,418	1,075,462,793	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	74,120,793	341,341,075	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	140,714,429	357,864,935	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	113,513,571	339,189,901	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	42,312,391	144,856,470	
親投資信託受益証券 合計			2,992,377,196	
合計			2,992,377,196	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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、当ファンドの特定期間末日（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。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	774,980,860円
Ⅱ	負債総額	588,055円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	774,392,805円
Ⅳ	発行済数量	796,733,491口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9720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5月31日

Ⅰ	資産総額	16,804,893,765円
Ⅱ	負債総額	18,615,597円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,786,278,168円
Ⅳ	発行済数量	8,927,121,094口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8804円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	108,112,006,186円
Ⅱ	負債総額	27,539,951円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	108,084,466,235円
Ⅳ	発行済数量	86,888,476,223口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2439円

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	87,880,629,215円
Ⅱ	負債総額	173,704,428円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	87,706,924,787円
Ⅳ	発行済数量	25,041,182,865口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5025円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	148,135,928,354円
Ⅱ	負債総額	1,557,032,395円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,578,895,959円
Ⅳ	発行済数量	42,305,924,547口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4647円

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	5,088,699,404円
Ⅱ	負債総額	1,722,000円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,086,977,404円
Ⅳ	発行済数量	1,045,907,025口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.8637円

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	1,705,010,918円
Ⅱ	負債総額	0円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,705,010,918円

Ⅳ	発行済数量	676,812,149口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5192円

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	737,006,777円
Ⅱ	負債総額	3,212,851円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	733,793,926円
Ⅳ	発行済数量	234,612,420口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1277円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	22,389,502,317円
Ⅱ	負債総額	577,194,813円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,812,307,504円
Ⅳ	発行済数量	5,377,490,770口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0562円

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	資産総額	599,421,021円
Ⅱ	負債総額	483,226円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	598,937,795円
Ⅳ	発行済数量	627,594,139口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9543円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

2023年5月31日

Ⅰ	**資産総額**	**3,042,456,603円**

Ⅱ　負債総額	2,601,465円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,039,855,138円
Ⅳ　発行済数量	2,902,446,686口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0473円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2023年5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5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	328,893
追加型株式投資信託	787	22,637,874
株式投資信託　　合計	879	22,966,767
単位型公社債投資信託	92	170,005
追加型公社債投資信託	14	1,536,737
公社債投資信託　合計	106	1,706,742
総合計	985	24,673,508

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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	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	株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	(注1)	
	寿証券株式会社	305百万円	(注1)	
	内藤証券株式会社	3,002百万円	(注1)	
	南都まほろば証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	ニュース証券株式会社	1,000百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	松井証券株式会社	11,945百万円	(注1)	
	松阪証券株式会社	100百万円	(注1)	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	楽天証券株式会社	17,495百万円	(注1)	
	株式会社きらやか銀行	24,200百万円	(注3)	
	岐阜信用金庫	20,664百万円	(注7)	(*1)
	株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	(注3)	
	ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレイション・リミテッド	※百万円	(注3)	(*2)
	株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	(注3)	
	湘南信用金庫	25,069百万円	(注7)	(*1)
	全国信用協同組合連合会	111,875百万円	(注5)	
	株式会社但馬銀行	5,481百万円	(注3)	
	株式会社東北銀行	13,233百万円	(注3)	
	株式会社東和銀行	38,653百万円	(注3)	
	株式会社栃木銀行	27,408百万円	(注3)	
	株式会社富山第一銀行	10,182百万円	(注3)	
	株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	(注3)	
	株式会社福島銀行	18,682百万円	(注3)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912ﾕｰﾛ (2021年12月31日現在)		
	コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	543千米ﾄﾞﾙ (2021年12月31日現在)		

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（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。
（*1）出資金を記載しています。
（*2）※1,239億4,847万9,495香港ドル、71億9,800万米ドル（香港ドル建と米ドル建の株式が発行されており、合算せずに併記しております。）

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】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しています。
委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しています。

第３【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2022年11月25日	臨時報告書
2023年1月24日	臨時報告書
2023年2月3日	有価証券報告書、有価証券届出書
2023年3月27日	臨時報告書

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23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」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2022年11月11日から2023年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2023年5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特定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。

独立監査人の監査報告書

2023年6月23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」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2022年11月11日から2023年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2023年5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特定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。

独立監査人の監査報告書

2023年6月23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」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2022年11月11日から2023年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2023年5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特定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。