

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2024年4月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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】	佐竹 優子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて、5,000億円を上限とし、合計で1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

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

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

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

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

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (6)【申込単位】

1円以上1円単位

**(7)【申込期間】**

2024年4月4日から2024年10月3日まで（継続申込期間）  
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

**(8)【申込取扱場所】**

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

**(9)【払込期日】**

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

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

**(10)【払込取扱場所】**

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

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

**(12)【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。  
一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

#### 商品分類表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの	
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
	年6回(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
	年12回(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの	

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

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

ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

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

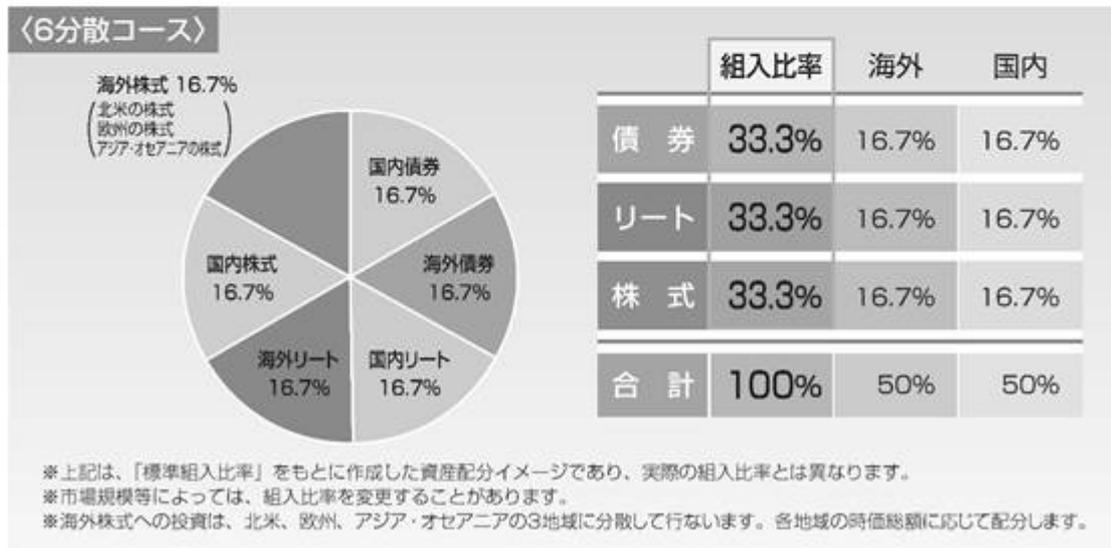
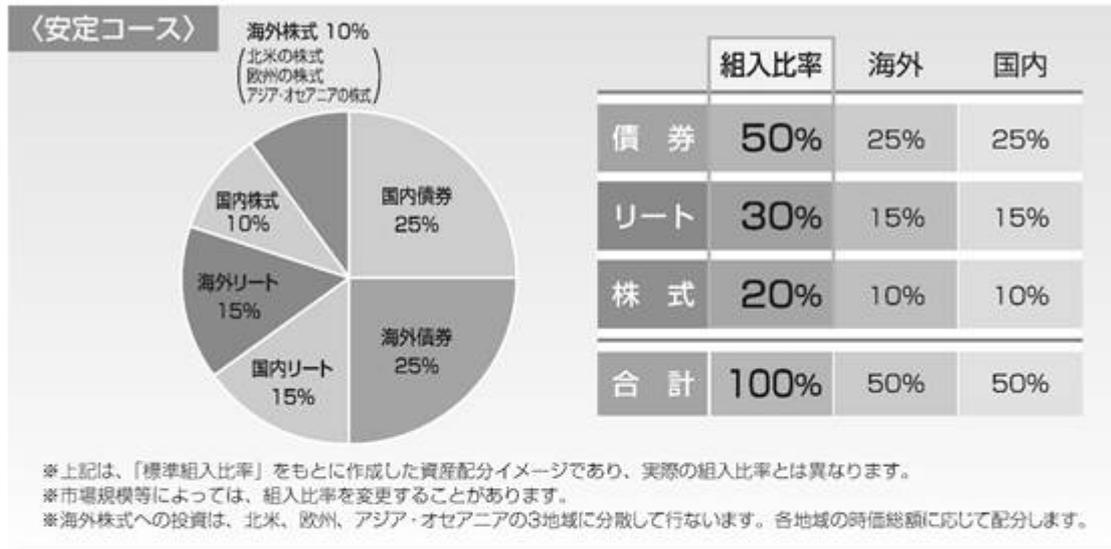
< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

# 1 内外の債券、リートおよび株式に投資します。

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



## 〈成長コース〉



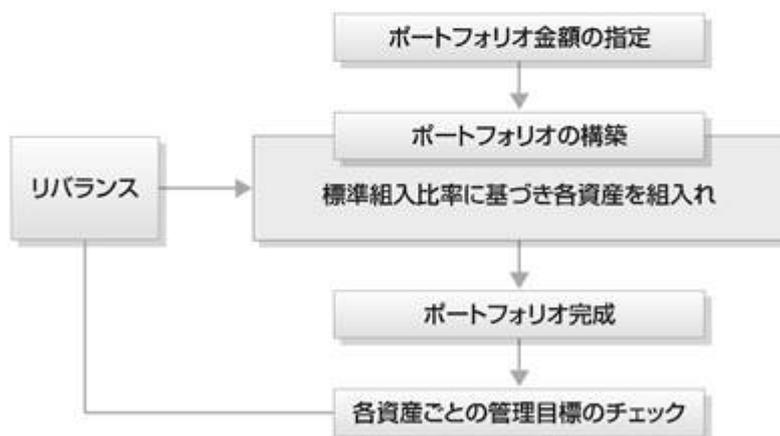
	組入比率	海外	国内
債券	10%	5%	5%
リート	40%	20%	20%
株式	50%	25%	25%
合計	100%	50%	50%

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

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

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

## 運用プロセス



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

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



## 2

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

## 運用プロセス



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

## ①為替レート変動への対応

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

## ②債券価格変動への対応

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

## ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

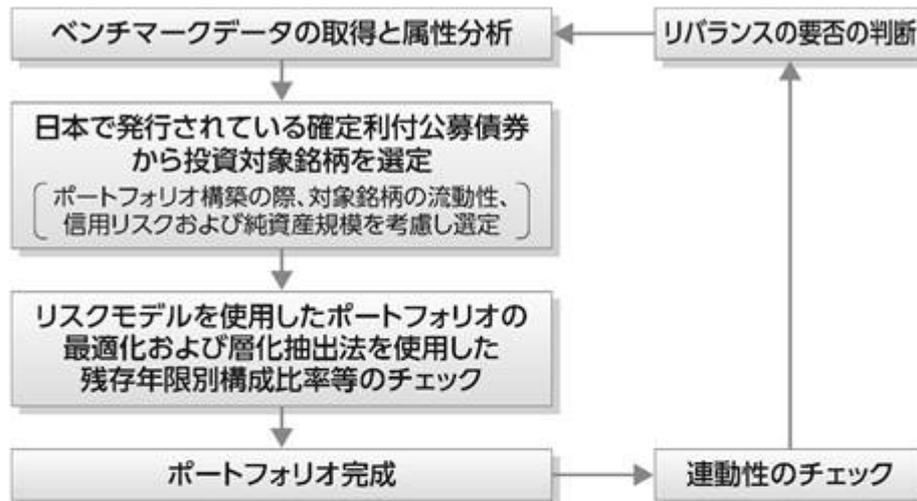
## FTSE世界国債インデックスとは

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

## 3

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

## NOMURA-BPI総合指数とは

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

NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利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に帰属します。なお、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は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

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

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

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

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



### 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

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

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

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 5

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

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

## 投資対象のイメージ



◆北米の株式の運用は、コーヘン&スティアーズ・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<sup>※</sup>を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

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

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

## 〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

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

6

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

### 投資対象のイメージ



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

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

### 銘柄選定プロセス



定量・定性分析による銘柄選定

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

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

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

7

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

8

毎年1月10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

#### 〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### 主な投資制限

● 株式への直接投資は、行ないません。

● 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

#### (2) 【ファンドの沿革】

2006年1月12日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
収益分配金（注1）、償還金など お申込金（ 5）		
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 5）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 5）	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）</li> <li>・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）</li> <li>・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）</li> </ul>	

（注1）収益分配金は、自動的に再投資されます。

（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（ 3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（ 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（2024年1月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

#### ・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

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

#### 1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

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

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

（注）3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

- ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ニ. 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2)【投資対象】

### <各ファンド共通>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. 約束手形
  - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法

第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

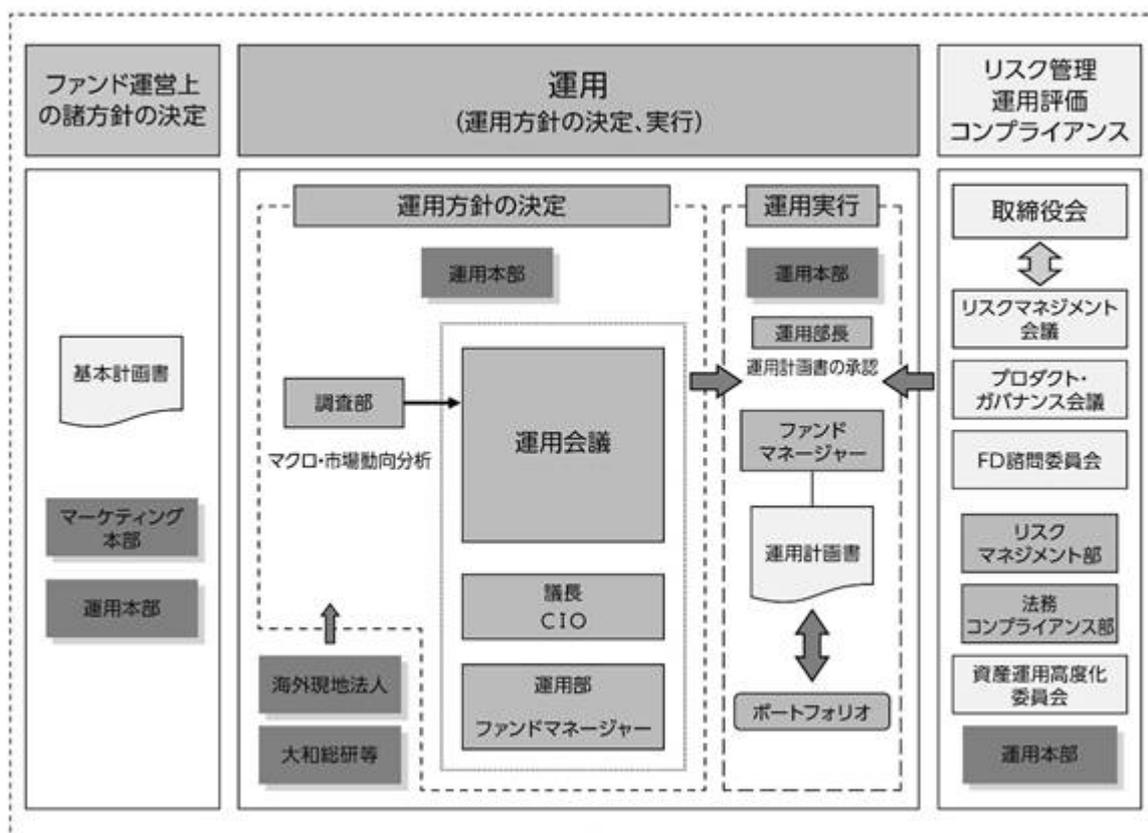
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ. 基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

#### ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

#### ニ．運用部長 (各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

#### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

#### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、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．プロダクト・ガバナンス会議

経営会議の分科会として、運用状況・商品性およびこれらの開示の適切性について検証結果の報告を行ない、対応方針を審議・決定したうえでその実行状況を確認します。加えて、その他当社が運用するプロダクトの品質の維持・向上に関する事項の審議・決定・報告を行ないます。

#### ハ．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。

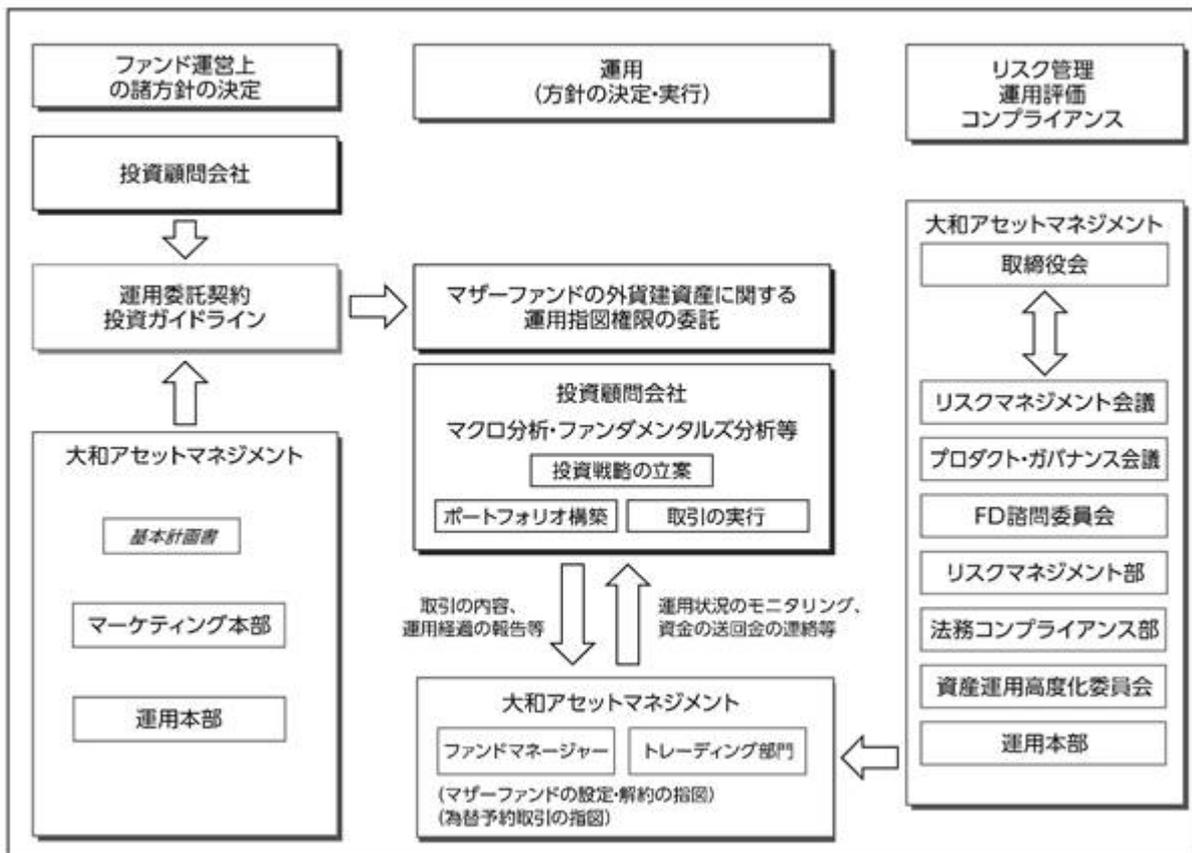
#### ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

## 受託会社に対する管理体制

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

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



### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

### ロ．運用の実行

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

### ハ．モニタリング

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

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

## ニ．リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2024年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

### (4)【分配方針】

#### <各ファンド共通>

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

### (5)【投資制限】

#### <各ファンド共通>

##### 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

##### 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

##### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

##### 外国為替予約取引（信託約款）

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

##### 信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

##### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

## <参考> マザーファンドの概要

### 1. 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### 投資態度

- イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### (2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの  
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

#### 株式

- イ. 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、
- ロ. 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

#### 同一銘柄の株式

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および

第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限りません。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を

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

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

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

### 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

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

##### 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

4. 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

### (4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

## 4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

ロ．先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信

託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに(2) 1. から4. に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

#### 5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

#### 6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

#### 7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

##### 主要投資対象

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

##### 投資態度

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

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

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

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

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

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

#### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

##### 主要投資対象

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

##### 投資態度

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

ロ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

(2) 投資対象

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

## 10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1. ~ 11.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

##### 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

##### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

##### 先物取引等

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

## 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

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

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1．株券または新株引受権証券

2．～10．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

12．～20．(ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定)

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

## (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2) 1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) 1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

#### ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

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

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還

金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともありま

す。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

## (3)その他の留意点

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

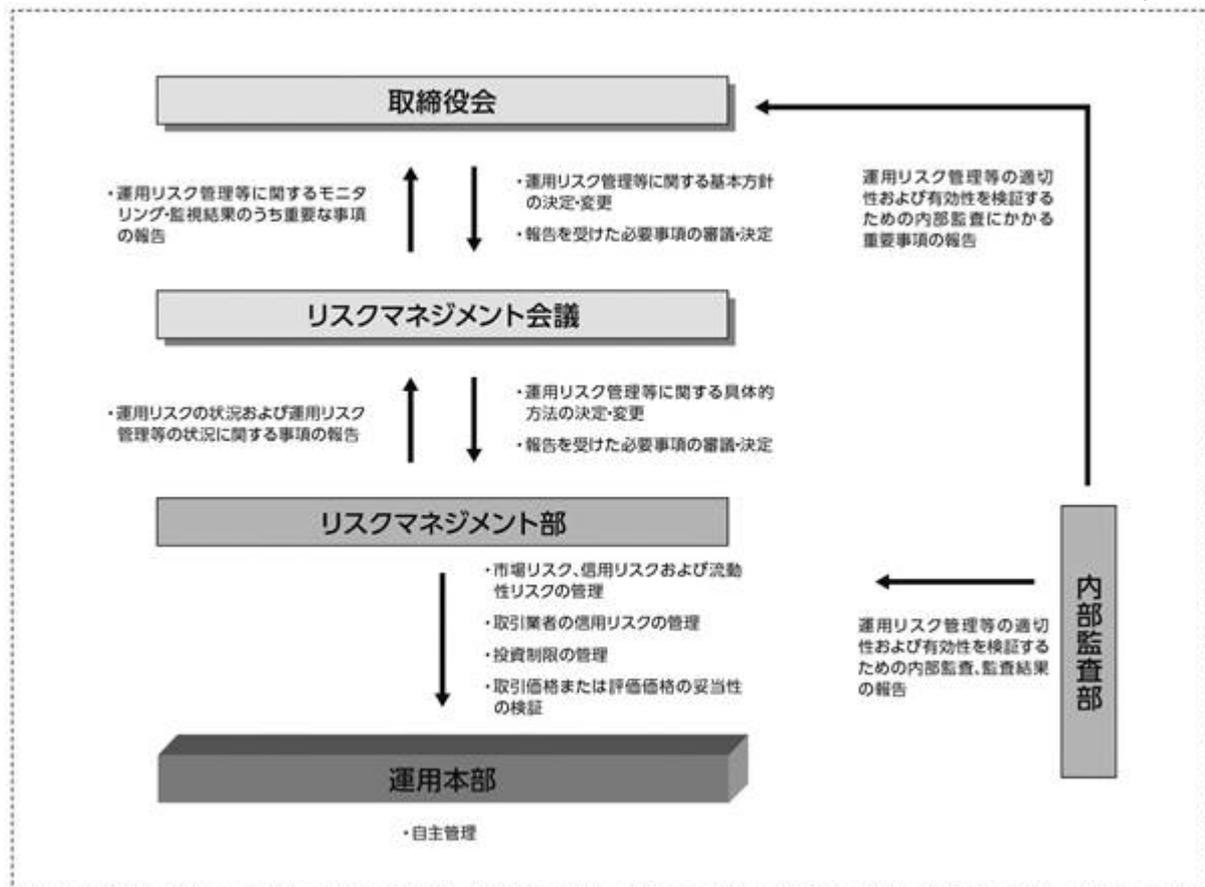
### 流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短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

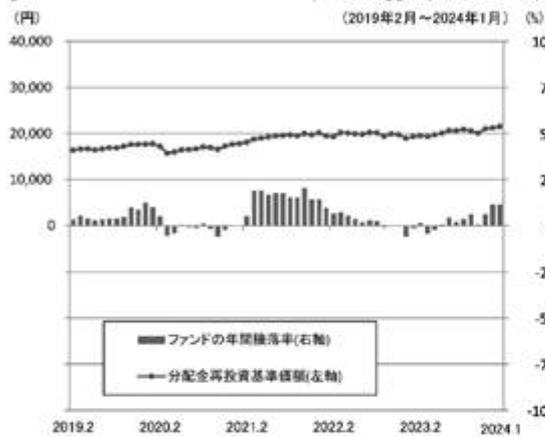
- ・ 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行いません。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

## 参考情報

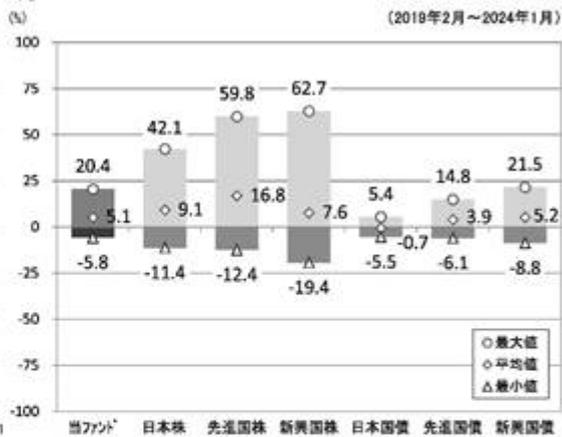
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

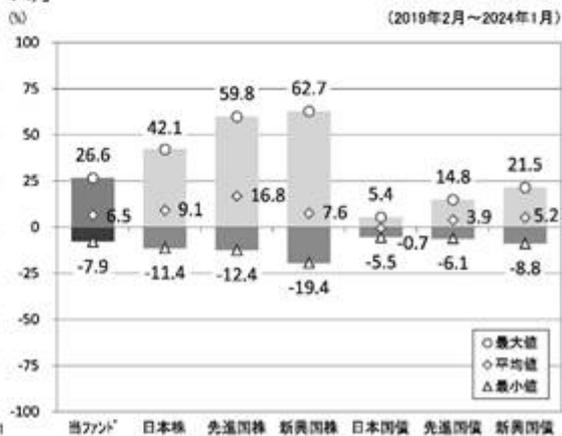
#### [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）]



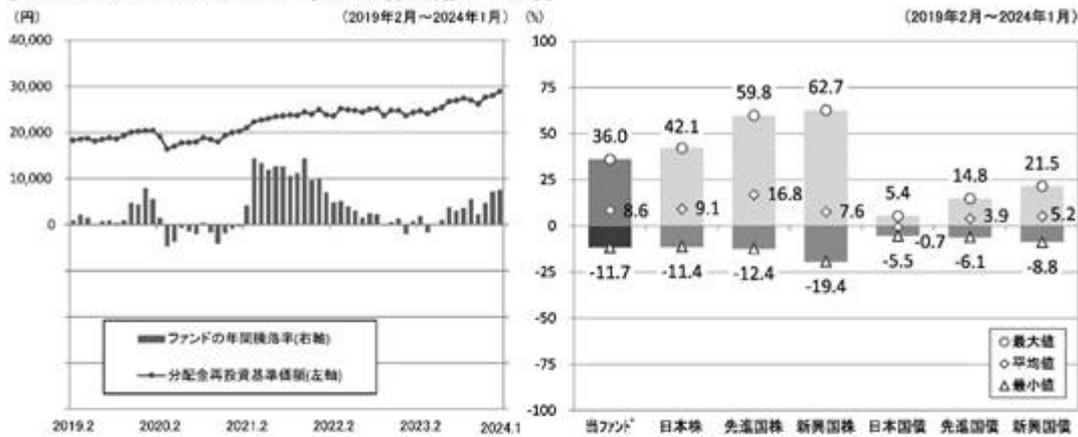
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）]



## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

## ※資産クラスについて

日本株：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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

## ※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社「J P X」総研または株式会社「J P X」総研の関連会社（以下「J P X」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準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P X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」）が発行した指数です。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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社	受託会社
安定コース	年率0.45% （税抜）	年率0.4% （税抜）	年率0.05% （税抜）
6分散コース	年率0.53% （税抜）	年率0.47% （税抜）	
成長コース	年率0.61% （税抜）	年率0.54% （税抜）	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

## イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

## ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4)【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

#### < マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

##### イ．収益分配金に対する課税

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

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

##### 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）」について

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。

当ファンドは、NISAの対象ではありません。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ ）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（ ）上記は、2024年1月末日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）】

## (1)【投資状況】（2024年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	9,868,375,173	99.12
内 日本	9,868,375,173	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	87,931,728	0.88
純資産総額	9,956,306,901	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】（2024年1月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	702,496,504	3.4429 2,418,668,661	3.4952 2,455,365,780	24.66
2	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,989,714,821	1.2320 2,451,518,240	1.2191 2,425,661,338	24.36
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	367,896,589	4.0387 1,485,823,958	4.0247 1,480,673,401	14.87
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	423,475,342	3.4609 1,465,638,709	3.4395 1,456,543,438	14.63
5	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	201,074,514	4.8750 980,238,258	5.1415 1,033,824,613	10.38
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	133,554,867	5.6737 757,750,252	5.9788 798,497,838	8.02

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	64,256,947	2.8366 182,275,373	2.8901 185,709,002	1.87
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,952,910	3.5205 31,519,203	3.5854 32,099,763	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,254,707,121	2,254,707,121	1.5471	1.5471
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,390,744,550	2,390,744,550	1.4830	1.4830
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715

第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
第15計算期間末 (2021年1月12日)	5,838,750,574	5,838,750,574	1.7702	1.7702
第16計算期間末 (2022年1月11日)	7,477,305,392	7,477,305,392	1.9976	1.9976
第17計算期間末 (2023年1月10日)	7,978,470,707	7,978,470,707	1.9057	1.9057
2023年1月末日	8,133,149,444	-	1.9290	-
2月末日	8,326,275,373	-	1.9539	-
3月末日	8,375,640,511	-	1.9329	-
4月末日	8,582,994,582	-	1.9717	-
5月末日	8,790,090,037	-	2.0033	-
6月末日	9,182,444,675	-	2.0693	-
7月末日	9,176,975,333	-	2.0616	-
8月末日	9,386,350,545	-	2.0889	-
9月末日	9,263,762,520	-	2.0550	-
10月末日	9,135,349,882	-	2.0099	-
11月末日	9,617,987,724	-	2.0999	-
12月末日	9,703,833,018	-	2.1187	-
第18計算期間末 (2024年1月10日)	9,782,814,525	9,782,814,525	2.1309	2.1309
2024年1月末日	9,956,306,901	-	2.1504	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第9計算期間	18.9
第10計算期間	4.1
第11計算期間	4.9
第12計算期間	5.4
第13計算期間	4.2
第14計算期間	12.2
第15計算期間	0.4
第16計算期間	12.8
第17計算期間	4.6
第18計算期間	11.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9計算期間	438,028,259	349,751,949
第10計算期間	345,342,005	190,621,495
第11計算期間	389,459,803	224,474,896
第12計算期間	458,208,043	289,727,307
第13計算期間	575,990,631	232,603,369
第14計算期間	809,239,523	304,172,889
第15計算期間	963,521,848	459,114,213
第16計算期間	842,864,166	398,104,027
第17計算期間	810,744,400	367,320,010
第18計算期間	793,333,632	389,010,333

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2024年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	282,601,579,802	96.97
内 ユーロ	92,224,063,562	31.65
内 中国	21,558,792,295	7.40
内 シンガポール	1,112,063,291	0.38
内 マレーシア	1,335,608,534	0.46
内 イスラエル	781,993,205	0.27
内 ノルウェー	481,319,930	0.17
内 スウェーデン	548,918,681	0.19

内 デンマーク	764,905,498	0.26
内 イギリス	14,401,685,239	4.94
内 ポーランド	1,477,277,992	0.51
内 カナダ	5,518,607,184	1.89
内 アメリカ	135,694,830,231	46.56
内 メキシコ	2,185,717,401	0.75
内 オーストラリア	3,891,759,874	1.34
内 ニュージーランド	624,036,885	0.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,823,706,879	3.03
純資産総額	291,425,286,681	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)	3,576,514,303	1.23
内 日本	3,576,514,303	1.23

(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 (2024年1月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,413,673,746	100.57 1,439,507,538	4.125000 2032/11/15	0.49
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	83.48 1,281,109,367	85.27 1,308,623,310	1.875000 2032/02/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,279,889,423	82.79 1,307,139,252	1.125000 2031/02/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,245,670,955	90.67 1,270,958,074	2.750000 2032/08/15	0.44
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,235,556,108	91.81 1,259,912,924	2.875000 2032/05/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,221,769,478	82.16 1,248,699,714	1.250000 2031/08/15	0.43
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,228,432,671	100.64 1,238,868,801	2.390000 2026/11/15	0.43

8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,189,592,365	82.41 1,216,018,570	1.375000 2031/11/15	0.42
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,155,794,266	81.61 1,180,086,898	0.875000 2030/11/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,110,307,848	95.88 1,131,838,344	3.500000 2033/02/15	0.39
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,069,964,284	85.09 1,092,351,750	1.625000 2031/05/15	0.37
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,070,684,475	94.84 1,091,538,602	3.375000 2033/05/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,064,861,525	94.31 1,075,547,204	1.625000 2026/05/15	0.37
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.27 1,066,628,631	103.63 1,070,363,112	4.500000 2033/11/15	0.37
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.81 999,922,742	98.65 1,018,968,496	3.875000 2033/08/15	0.35
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	100.18 945,399,369	100.93 952,524,025	2.750000 2027/10/25	0.33
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 941,081,277	92.16 951,936,531	1.125000 2026/10/31	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 930,922,460	80.59 951,366,988	0.625000 2030/08/15	0.33
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 929,863,051	95.26 941,755,728	2.875000 2028/08/15	0.32
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 904,426,906	95.47 915,667,265	2.875000 2028/05/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 899,156,715	93.73 912,848,765	2.625000 2029/02/15	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 894,138,245	87.92 908,154,019	0.750000 2028/01/31	0.31
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.09 892,812,508	94.16 903,084,201	0.250000 2025/06/30	0.31
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 884,903,385	94.72 894,516,563	2.375000 2027/05/15	0.31
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 881,363,070	95.19 891,941,151	2.750000 2028/02/15	0.31
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 883,529,400	100.38 888,699,552	4.375000 2026/08/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 878,522,290	92.66 888,678,895	1.500000 2027/01/31	0.30

28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.53 819,230,061	93.98 832,022,646	2.750000 2029/05/31	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	40,000,000	99.73 818,469,293	101.37 831,960,680	2.670000 2033/05/25	0.29
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	95.51 823,079,581	96.29 829,740,460	2.250000 2025/11/15	0.28

(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	96.97%
合計	96.97%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2024年2月	買建	1,294,000	233,785,576	242,208,401	0.08%
		イスラエル・シェケル買/円売 2024年2月	買建	1,446,000	56,383,155	58,279,294	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2024年2月	買建	6,529,000	53,763,050	56,060,605	0.02%
		ユーロ買/円売 2024年2月	買建	2,387,000	382,041,194	381,676,814	0.13%
		オフショア人民元買/円売 2024年2月	買建	111,712,000	2,251,807,217	2,291,148,848	0.79%
		米ドル買/円売 2024年2月	買建	3,462,000	509,433,266	510,532,958	0.18%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2024年2月	買建	405,000	35,967,483	36,607,383	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。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

### (1) 投資状況 (2024年1月31日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	45,887,157,920	84.11
内 日本	45,887,157,920	84.11
地方債証券	3,179,097,593	5.83
内 日本	3,179,097,593	5.83
特殊債券	1,843,809,308	3.38
内 日本	1,843,809,308	3.38
社債券	3,372,484,900	6.18
内 日本	3,372,484,900	6.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	276,761,501	0.51
純資産総額	54,559,311,222	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 (2024年1月31日現在)

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	145 5年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	100.17 1,071,829,700	100.13 1,071,391,000	0.100000 2025/09/20	1.96
2	143 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.16 881,425,200	100.15 881,337,600	0.100000 2025/03/20	1.62
3	144 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.16 801,358,500	100.14 801,152,000	0.100000 2025/06/20	1.47
4	147 5年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.91 799,352,000	99.88 799,064,000	0.005000 2026/03/20	1.46
5	347 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	99.91 689,385,900	99.89 689,303,100	0.100000 2027/06/20	1.26

6	149 5年国債	日本	国債証券	650,000,000	99.83 648,930,200	99.82 648,888,500	0.005000 2026/09/20	1.19
7	156 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	100.12 600,720,000	100.05 600,342,000	0.200000 2027/12/20	1.10
8	358 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	98.42 590,570,400	98.49 590,994,000	0.100000 2030/03/20	1.08
9	366 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	97.18 583,098,000	97.16 582,978,000	0.200000 2032/03/20	1.07
10	148 5年国債	日本	国債証券	570,000,000	99.87 569,297,500	99.85 569,184,900	0.005000 2026/06/20	1.04
11	150 5年国債	日本	国債証券	560,000,000	99.77 558,715,000	99.76 558,706,400	0.005000 2026/12/20	1.02
12	370 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	98.81 543,477,000	98.66 542,652,000	0.500000 2033/03/20	0.99
13	146 5年国債	日本	国債証券	540,000,000	100.15 540,826,200	100.09 540,507,600	0.100000 2025/12/20	0.99
14	362 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	97.42 535,826,500	97.58 536,701,000	0.100000 2031/03/20	0.98
15	154 5年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.82 519,110,800	99.78 518,871,600	0.100000 2027/09/20	0.95
16	353 10年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.17 515,720,400	99.06 515,117,200	0.100000 2028/12/20	0.94
17	369 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.01 495,065,000	98.90 494,530,000	0.500000 2032/12/20	0.91
18	360 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	97.94 489,740,000	98.09 490,465,000	0.100000 2030/09/20	0.90
19	371 10年国債	日本	国債証券	480,000,000	97.70 468,993,600	97.53 468,144,000	0.400000 2033/06/20	0.86
20	151 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	99.67 448,519,500	99.68 448,596,000	0.005000 2027/03/20	0.82
21	363 10年国債	日本	国債証券	460,000,000	97.16 446,936,000	97.25 447,377,600	0.100000 2031/06/20	0.82
22	364 10年国債	日本	国債証券	450,000,000	96.88 435,996,800	96.95 436,284,000	0.100000 2031/09/20	0.80
23	356 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	98.80 434,728,800	98.78 434,640,800	0.100000 2029/09/20	0.80
24	348 10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.82 429,264,700	99.78 429,066,900	0.100000 2027/09/20	0.79
25	349 10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.71 428,787,400	99.67 428,589,600	0.100000 2027/12/20	0.79

26	158 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.59 428,258,500	99.54 428,060,700	0.100000 2028/03/20	0.78
27	357 10年国債	日本	国債証券	420,000,000	98.63 414,267,000	98.67 414,422,400	0.100000 2029/12/20	0.76
28	345 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	100.04 410,184,500	100.04 410,176,300	0.100000 2026/12/20	0.75
29	361 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	97.67 400,458,240	97.85 401,221,900	0.100000 2030/12/20	0.74
30	161 5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.35 401,437,000	100.26 401,040,000	0.300000 2028/06/20	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.11%
地方債証券	5.83%
特殊債券	3.38%
社債券	6.18%
合計	99.49%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資状況（2024年1月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	91,632,425,616	97.55
内 香港	2,257,639,347	2.40

内 シンガポール	7,007,714,526	7.46
内 イギリス	9,482,769,774	10.10
内 オランダ	518,266,644	0.55
内 ベルギー	3,105,258,310	3.31
内 フランス	4,214,741,556	4.49
内 スペイン	990,458,006	1.05
内 カナダ	2,171,360,376	2.31
内 アメリカ	46,243,701,861	49.23
内 オーストラリア	14,856,190,028	15.82
内 ニュージーランド	784,325,188	0.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,298,866,594	2.45
純資産総額	93,931,292,210	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)	247,789,559	0.26
内 日本	247,789,559	0.26
為替予約取引(売建)	247,845,354	0.26
内 日本	247,845,354	0.26

(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 (2024年1月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,358,485	2,195.33 5,177,860,475	2,456.20 5,792,922,178	6.17
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	245,521	18,264.18 4,484,250,099	18,669.50 4,583,754,678	4.88
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	321,426	12,544.70 4,032,237,047	12,826.52 4,122,777,500	4.39
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	186,412	17,319.41 3,228,547,535	20,544.86 3,829,808,815	4.08
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	173,901	19,006.65 3,305,290,295	21,279.66 3,700,554,328	3.94

6	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	676,628	5,175.75 3,502,091,585	4,880.95 3,302,590,143	3.52
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	366,992	7,988.94 2,931,904,055	8,141.80 2,987,978,769	3.18
8	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	22,905	116,367.07 2,665,390,935	124,175.12 2,844,231,330	3.03
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	109,819	19,483.68 2,139,686,746	21,477.37 2,358,624,175	2.51
10	LINK REIT	香港	投資証券	3,036,592	703.85 2,137,308,316	743.47 2,257,639,347	2.40
11	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,360,731	1,434.19 1,951,559,758	1,642.13 2,234,503,700	2.38
12	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	104,747	18,526.52 1,940,608,518	18,337.51 1,920,799,579	2.04
13	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,843,177	414.23 2,006,233,766	377.88 1,830,154,739	1.95
14	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,139,681	388.64 1,608,845,624	434.30 1,797,884,985	1.91
15	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	165,014	8,183.74 1,350,456,020	10,705.19 1,766,506,619	1.88
16	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,395,903	1,135.40 1,585,150,253	1,243.87 1,736,323,540	1.85
17	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	381,404	4,570.80 1,743,323,877	4,461.91 1,701,791,084	1.81
18	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	166,837	9,187.93 1,532,910,857	10,071.76 1,680,342,724	1.79
19	UDR INC	アメリカ	投資証券	306,838	5,658.98 1,736,399,594	5,382.62 1,651,593,583	1.76
20	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,379,994	995.89 1,374,322,225	1,164.94 1,607,621,802	1.71
21	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	7,399,200	208.44 1,542,520,697	217.03 1,605,884,632	1.71
22	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証券	5,014,286	267.31 1,341,133,009	310.78 1,558,342,159	1.66
23	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	3,356,357	404.76 1,358,638,208	439.16 1,473,988,480	1.57
24	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	3,433,109	416.52 1,430,230,583	428.47 1,471,003,439	1.57
25	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	アメリカ	投資証券	588,714	2,464.82 1,451,113,776	2,382.93 1,402,865,724	1.49

26	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	461,486	2,814.95 1,299,077,823	3,020.34 1,393,848,548	1.48
27	KLEPIERRE	フランス	投資証券	354,594	3,858.63 1,368,258,239	3,844.07 1,363,087,384	1.45
28	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	144,295	8,357.52 1,205,950,494	9,199.74 1,327,476,844	1.41
29	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	6,167,817	221.23 1,364,621,538	206.95 1,276,434,662	1.36
30	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	シンガポール	投資証券	7,322,000	185.30 1,357,552,142	171.86 1,258,396,994	1.34

(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	97.55%
合計	97.55%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2024年 2月	買建	885,371	165,869,110	165,831,804	0.18%
		ユーロ買/円売 2024年2 月	買建	512,392	82,014,549	81,957,755	0.09%
		米ドル売/円買 2024年2 月	売建	1,679,998	247,883,659	247,845,354	0.26%

(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（2024年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	166,635,866,300	97.39
内 日本	166,635,866,300	97.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,469,915,259	2.61
純資産総額	171,105,781,559	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)	3,198,726,000	1.87
内 日本	3,198,726,000	1.87

(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（2024年1月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	18,881	607,702.92 11,474,038,875	597,000.00 11,271,957,000	6.59
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	42,364	274,877.11 11,644,893,929	262,600.00 11,124,786,400	6.50
3	GLP投資法人	日本	投資証券	74,382	136,544.20 10,156,430,740	131,700.00 9,796,109,400	5.73
4	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	35,870	268,799.61 9,641,842,083	260,700.00 9,351,309,000	5.47
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	53,694	161,211.69 8,656,100,858	160,200.00 8,601,778,800	5.03
6	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	82,514	98,084.71 8,093,362,301	100,200.00 8,267,902,800	4.83

7	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	12,478	565,846.09 7,060,627,601	566,000.00 7,062,548,000	4.13
8	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	92,821	66,725.90 6,193,565,203	75,900.00 7,045,113,900	4.12
9	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	10,525	608,105.93 6,400,314,995	614,000.00 6,462,350,000	3.78
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	37,736	170,493.24 6,433,733,272	170,600.00 6,437,761,600	3.76
11	野村不動産マスターF	日本	投資証券	39,169	166,481.65 6,520,920,109	161,400.00 6,321,876,600	3.69
12	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	14,002	376,834.14 5,276,431,687	369,500.00 5,173,739,000	3.02
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	15,617	324,913.89 5,074,180,285	325,000.00 5,075,525,000	2.97
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	14,158	347,654.29 4,922,089,495	353,500.00 5,004,853,000	2.93
15	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	32,296	149,125.55 4,816,159,096	149,400.00 4,825,022,400	2.82
16	イオンリート投資	日本	投資証券	29,138	142,821.30 4,161,527,051	138,900.00 4,047,268,200	2.37
17	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	22,881	150,617.88 3,446,287,734	155,300.00 3,553,419,300	2.08
18	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	23,442	149,999.18 3,516,280,875	149,400.00 3,502,234,800	2.05
19	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	55,834	57,535.57 3,212,441,345	60,700.00 3,389,123,800	1.98
20	産業ファンド	日本	投資証券	25,112	136,284.18 3,422,368,539	133,600.00 3,354,963,200	1.96
21	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	9,785	317,815.91 3,109,828,719	309,500.00 3,028,457,500	1.77
22	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,725	342,352.47 2,987,025,329	341,500.00 2,979,587,500	1.74
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	18,440	139,008.34 2,563,313,877	137,200.00 2,529,968,000	1.48
24	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	22,911	108,777.68 2,492,205,537	106,100.00 2,430,857,100	1.42
25	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	16,902	127,574.26 2,156,260,220	125,200.00 2,116,130,400	1.24
26	API投資法人	日本	投資証券	5,026	399,077.53 2,005,763,693	402,000.00 2,020,452,000	1.18

27	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	3,180	652,997.98 2,076,533,606	629,000.00 2,000,220,000	1.17
28	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	25,302	78,205.68 1,978,760,381	78,500.00 1,986,207,000	1.16
29	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4,549	452,490.93 2,058,381,275	436,000.00 1,983,364,000	1.16
30	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,455	463,659.20 2,065,601,754	442,500.00 1,971,337,500	1.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.39%
合計	97.39%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	TREIT 先物 0603月	買建	1,791	3,205,154,960	3,198,726,000	1.87%

(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 (2024年1月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	4,570,439,460	75.48
内 カナダ	98,776,892	1.63
内 アメリカ	4,471,662,568	73.85
ハイブリッド優先証券	1,079,785,787	17.83
内 アメリカ	1,079,785,787	17.83
投資証券	66,080,389	1.09
内 アメリカ	66,080,389	1.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	339,140,086	5.60
純資産総額	6,055,445,722	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（2024年1月31日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,465	48,356.56 264,268,609	60,287.45 329,470,939	5.44
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	11,730	26,513.40 311,003,808	27,745.30 325,452,392	5.37
3	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,023	130,313.20 133,310,413	178,264.00 182,364,080	3.01
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	7,273	19,150.51 139,281,692	23,460.45 170,627,853	2.82
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	7,055	20,073.73 141,620,762	22,347.92 157,664,597	2.60
6	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,553	67,077.70 104,171,677	92,623.03 143,843,576	2.38
7	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	2,037	46,432.50 94,583,022	59,028.85 120,241,774	1.99

8	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,872	36,638.14 68,586,599	43,475.60 81,386,337	1.34
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	3,077	21,837.40 67,193,680	26,008.63 80,028,581	1.32
10	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	843	80,969.53 68,257,321	92,655.49 78,108,585	1.29
11	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	2,071	30,778.93 63,743,164	36,927.33 76,476,518	1.26
12	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,525	16,293.94 57,436,161	19,036.90 67,105,076	1.11
13	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,164	45,637.21 53,121,718	57,082.66 66,444,226	1.10
14	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	10,535	4,525.35 47,674,652	6,266.44 66,017,035	1.09
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,248	45,299.32 56,533,604	52,690.10 65,757,251	1.09
16	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ	株式	情報技術	2,553	15,506.02 39,586,893	25,387.45 64,814,168	1.07
17	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	1,552	35,068.20 54,425,860	40,893.48 63,466,685	1.05
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	924	58,729.32 54,265,898	65,687.78 60,695,513	1.00
19	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,332	15,759.81 52,512,176	17,950.93 59,812,509	0.99
20	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	2,694	24,053.30 64,799,666	22,150.20 59,672,655	0.99
21	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	576	83,637.24 48,175,051	103,394.18 59,555,052	0.98
22	CSX CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービス	10,864	4,677.33 50,814,731	5,289.66 57,466,948	0.95
23	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	2,033	20,429.77 41,533,729	27,720.21 56,355,204	0.93
24	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,347	23,143.21 54,317,131	23,426.51 54,982,027	0.91
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	10,623	4,020.14 42,707,530	5,133.26 54,530,669	0.90

26	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	アメリカ	株式	金融	6,501	6,649.04 43,226,359	8,268.70 53,754,832	0.89
27	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	462	81,102.33 37,469,278	115,934.46 53,561,721	0.88
28	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	1,868	23,507.66 43,912,615	27,608.08 51,571,894	0.85
29	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	5,984	6,448.23 38,586,327	8,423.62 50,406,999	0.83
30	DEERE & CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	834	56,166.38 46,842,763	58,567.02 48,844,896	0.81

(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	75.48%
ハイブリッド優先証券	17.83%
投資証券	1.09%
合計	94.40%

(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	3.56%
素材	1.92%
資本財・サービス	6.34%
一般消費財・サービス	7.66%
生活必需品	5.13%
ヘルスケア	9.12%
金融	10.46%
情報技術	22.46%
コミュニケーション・サービス	7.08%
公益事業	1.74%
合計	75.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ欧州好配当株マザーファンド

### (1) 投資状況（2024年1月31日現在）

#### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,702,102,261	95.21
	内 スウェーデン	3,535,417	0.20
	内 デンマーク	19,781,450	1.11
	内 イギリス	357,077,671	19.97
	内 オランダ	106,619,476	5.96
	内 フランス	386,237,656	21.61
	内 ドイツ	354,438,241	19.83
	内 スイス	334,204,004	18.70
	内 スペイン	21,022,264	1.18
	内 イタリア	119,186,082	6.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		85,545,942	4.79
純資産総額		1,787,648,203	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（2024年1月31日現在）

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,718	17,644.20 100,889,556	16,950.96 96,925,618	5.42
2	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,784	24,494.60 68,192,984	29,514.46 82,168,271	4.60
3	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,870	21,352.79 61,282,523	27,086.12 77,737,166	4.35
4	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,498	14,980.79 67,383,631	15,848.63 71,287,139	3.99

5	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	19,003	3,262.58 61,998,962	3,659.31 69,537,938	3.89
6	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,793	26,507.02 47,527,103	33,353.74 59,803,265	3.35
7	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,990	16,537.69 65,985,417	14,789.22 59,009,014	3.30
8	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,346	43,656.90 58,762,199	42,227.63 56,838,402	3.18
9	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	12,054	5,099.12 61,464,824	4,634.54 55,864,796	3.13
10	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	742	73,277.87 54,372,185	75,040.92 55,680,369	3.11
11	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	5,570	10,105.30 56,286,548	9,666.98 53,845,118	3.01
12	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	44,484	1,222.51 54,382,382	1,163.69 51,765,761	2.90
13	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需 品	90,643	516.28 46,797,301	547.19 49,599,027	2.77
14	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	49,350	915.50 45,180,335	1,000.77 49,388,114	2.76
15	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	79	495,537.15 39,147,435	620,320.08 49,005,286	2.74
16	AXA SA	フランス	株式	金融	9,470	4,480.75 42,432,794	4,980.66 47,166,907	2.64
17	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費 財・サービ ス	3,071	15,638.66 48,026,347	15,197.15 46,670,448	2.61
18	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,174	35,641.31 41,842,905	39,608.57 46,500,464	2.60
19	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	90,114	506.14 45,610,757	500.86 45,135,044	2.52
20	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	695	60,452.66 42,014,601	62,964.19 43,760,113	2.45
21	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費 財・サービ ス	8,835	4,643.92 41,029,114	4,930.27 43,558,983	2.44
22	DHL GROUP	ドイツ	株式	資本財・ サービス	6,108	6,227.63 38,038,377	7,109.86 43,427,065	2.43

23	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	4,089	9,220.67 37,703,323	9,950.13 40,686,098	2.28
24	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	82,889	384.88 31,902,966	460.23 38,148,310	2.13
25	GSK	イギリス	株式	ヘルスケア	13,036	2,828.68 36,874,712	2,880.76 37,553,596	2.10
26	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	18,318	1,834.71 33,608,218	1,960.40 35,910,762	2.01
27	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	1,845	18,244.57 33,661,247	18,244.57 33,661,247	1.88
28	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	4,602	7,355.51 33,850,068	7,222.50 33,237,983	1.86
29	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	13,257	2,479.21 32,866,953	2,387.39 31,649,658	1.77
30	M&G PLC	イギリス	株式	金融	70,474	367.91 25,928,520	430.29 30,324,750	1.70

(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
株式	95.21%
合計	95.21%

(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	7.91%
素材	6.12%
資本財・サービス	11.37%
一般消費財・サービス	5.25%
生活必需品	11.61%
ヘルスケア	13.93%
金融	22.57%
情報技術	3.35%
コミュニケーション・サービス	7.17%
公益事業	5.95%
合計	95.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況（2024年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		691,221,268	97.00
	内 韓国	147,816,891	20.74
	内 台湾	200,193,892	28.09
	内 香港	62,943,621	8.83
	内 シンガポール	49,148,820	6.90
	内 オーストラリア	231,118,044	32.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		21,400,336	3.00
純資産総額		712,621,604	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)		2,914,437	0.41
	内 日本	2,914,437	0.41

(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) 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（2024年1月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	22,000	2,619.22 57,623,042	3,040.76 66,896,914	9.39

2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	7,630	7,541.20 57,539,356	8,239.87 62,870,208	8.82
3	BHP GROUP LTD	オーストラ リア	株式	素材	8,690	4,373.17 38,002,861	4,571.37 39,725,275	5.57
4	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラ リア	株式	金融	2,830	9,870.77 27,934,414	11,275.41 31,909,433	4.48
5	CSL LTD	オーストラ リア	株式	ヘルスケア	850	23,774.17 20,208,067	28,831.25 24,506,570	3.44
6	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	19,600	1,288.82 25,260,892	1,169.94 22,930,824	3.22
7	WESFARMERS LTD	オーストラ リア	株式	一般消費 財・サービ ス	3,680	5,134.90 18,896,454	5,626.53 20,705,651	2.91
8	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラ リア	株式	金融	6,300	2,848.73 17,947,007	3,121.75 19,667,030	2.76
9	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラ リア	株式	金融	1,000	16,656.33 16,656,389	18,267.05 18,267,052	2.56
10	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	4,000	3,988.04 15,952,195	4,561.15 18,244,613	2.56
11	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	1,200	13,829.23 16,595,076	15,182.21 18,218,652	2.56
12	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポー ル	株式	金融	5,000	3,720.44 18,602,205	3,505.60 17,528,047	2.46
13	RIO TINTO LTD	オーストラ リア	株式	素材	1,340	11,265.21 15,095,430	12,869.81 17,245,550	2.42
14	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	オーストラ リア	株式	金融	6,550	2,497.98 16,361,793	2,602.91 17,049,102	2.39
15	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	34,000	509.16 17,311,542	483.11 16,425,835	2.30
16	WESTPAC BANKING CORP	オーストラ リア	株式	金融	7,000	2,086.99 14,608,978	2,314.35 16,200,458	2.27
17	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポー ル	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	59,800	262.20 15,679,835	266.61 15,943,362	2.24
18	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	シンガポー ル	株式	金融	11,100	1,430.00 15,873,073	1,412.37 15,677,411	2.20
19	ASIA CEMENT CORP	台湾	株式	素材	71,000	192.29 13,653,147	188.50 13,384,119	1.88

20	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	2,900	5,517.58 16,001,005	4,528.80 13,133,520	1.84
21	KT&G CORP	韓国	株式	生活必需品	1,300	9,648.30 12,542,790	9,870.10 12,831,130	1.80
22	ASUSTEK COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	6,000	1,728.78 10,372,716	2,119.53 12,717,234	1.78
23	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	52,000	222.61 11,575,762	234.92 12,216,123	1.71
24	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	3,778	3,473.47 13,122,770	3,096.48 11,698,536	1.64
25	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	18,000	551.79 9,932,231	644.15 11,594,707	1.63
26	KIA CORP	韓国	株式	一般消費財・サービス	1,040	9,337.78 9,711,291	10,868.20 11,302,928	1.59
27	SAMSUNG SDS CO LTD	韓国	株式	情報技術	640	15,026.95 9,617,248	16,901.16 10,816,742	1.52
28	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	香港	株式	金融	27,000	404.76 10,928,561	359.66 9,710,879	1.36
29	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	台湾	株式	情報技術	4,000	2,067.43 8,269,754	2,406.09 9,624,365	1.35
30	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	7,000	1,555.90 10,891,352	1,354.61 9,482,273	1.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### 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	97.00%
合計	97.00%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.17%
素材	12.92%
資本財・サービス	2.56%
一般消費財・サービス	4.49%
生活必需品	1.80%
ヘルスケア	3.44%

金融	25.55%
情報技術	37.19%
コミュニケーション・サービス	4.02%
公益事業	1.98%
不動産	0.88%
合計	97.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2024年2 月	買建	30,000	2,906,460	2,914,437	0.41%

(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。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

##### (1) 投資状況 (2024年1月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	33,929,260,270	95.36
内 日本	33,929,260,270	95.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,651,961,032	4.64
純資産総額	35,581,221,302	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)	434,095,000	1.22
内 日本	434,095,000	1.22

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

(注2) 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（2024年1月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	597,600	2,668.66 1,594,794,704	3,000.00 1,792,800,000	5.04
2	東京海上HD	日本	株式	保険業	399,800	3,385.59 1,353,562,407	3,930.00 1,571,214,000	4.42
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,103,900	1,237.20 1,365,751,784	1,395.00 1,539,940,500	4.33
4	三菱商事	日本	株式	卸売業	487,500	2,366.22 1,153,534,808	2,565.00 1,250,437,500	3.51
5	日立	日本	株式	電気機器	106,600	9,102.55 970,332,580	11,675.00 1,244,555,000	3.50
6	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	6,530,100	172.24 1,124,784,494	186.30 1,216,557,630	3.42
7	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	131,200	7,249.07 951,078,414	7,700.00 1,010,240,000	2.84
8	小松製作所	日本	株式	機械	209,600	3,819.18 800,500,888	4,245.00 889,752,000	2.50
9	住友電工	日本	株式	非鉄金属	429,500	1,713.83 736,091,546	1,976.00 848,692,000	2.39
10	三菱重工業	日本	株式	機械	83,800	8,256.23 691,872,840	9,942.00 833,139,600	2.34
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	488,900	1,639.44 801,524,925	1,675.50 819,151,950	2.30
12	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	247,000	2,839.07 701,250,517	3,227.00 797,069,000	2.24
13	大東建託	日本	株式	不動産業	43,000	15,781.15 678,589,871	16,825.00 723,475,000	2.03
14	SANKYO	日本	株式	機械	79,600	7,399.06 588,965,324	9,052.00 720,539,200	2.03
15	上組	日本	株式	倉庫・運輸 関連業	196,600	3,065.82 602,740,619	3,405.00 669,423,000	1.88

16	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	23,900	20,478.59 489,438,499	27,865.00 665,973,500	1.87
17	日本郵船	日本	株式	海運業	125,900	4,000.33 503,642,462	5,098.00 641,838,200	1.80
18	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	62,900	8,644.09 543,713,746	9,410.00 591,889,000	1.66
19	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	287,000	1,806.44 518,450,213	2,032.50 583,327,500	1.64
20	三井住友トラストHD	日本	株式	銀行業	185,400	2,779.77 515,369,448	3,041.00 563,801,400	1.58
21	大阪瓦斯	日本	株式	電気・ガス業	166,400	2,524.50 420,077,143	3,112.00 517,836,800	1.46
22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	294,500	1,897.08 558,690,512	1,725.00 508,012,500	1.43
23	日本製鉄	日本	株式	鉄鋼	138,400	3,287.12 454,938,679	3,570.00 494,088,000	1.39
24	ダイヘン	日本	株式	電気機器	69,500	5,659.99 393,369,545	7,040.00 489,280,000	1.38
25	丸井グループ	日本	株式	小売業	194,200	2,309.26 448,459,805	2,452.50 476,275,500	1.34
26	KDDI	日本	株式	情報・通信業	94,700	4,463.76 422,718,816	4,897.00 463,745,900	1.30
27	鹿島建設	日本	株式	建設業	175,000	2,398.70 419,773,072	2,644.00 462,700,000	1.30
28	フジクラ	日本	株式	非鉄金属	340,500	1,178.05 401,126,737	1,223.50 416,601,750	1.17
29	BIPROGY	日本	株式	情報・通信業	93,400	3,644.39 340,386,821	4,332.00 404,608,800	1.14
30	東急不動産HD	日本	株式	不動産業	387,400	912.73 353,594,295	993.40 384,843,160	1.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.36%
合計	95.36%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.46%
鉱業	0.26%
建設業	2.81%
食料品	1.02%
繊維製品	1.24%
パルプ・紙	0.26%
化学	5.36%
医薬品	1.93%
石油・石炭製品	0.97%
ゴム製品	0.97%
鉄鋼	2.59%
非鉄金属	4.61%
金属製品	1.90%
機械	7.84%
電気機器	7.90%
輸送用機器	9.29%
その他製品	0.58%
電気・ガス業	1.46%
陸運業	1.89%
海運業	1.80%
倉庫・運輸関連業	2.09%
情報・通信業	6.83%
卸売業	9.24%
小売業	2.25%
銀行業	9.69%
証券、商品先物取引業	0.11%
保険業	4.71%
その他金融業	0.68%
不動産業	3.44%
サービス業	1.18%
合計	95.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位:円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0603月	買建	17	396,959,350	434,095,000	1.22%

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

(注2) 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。

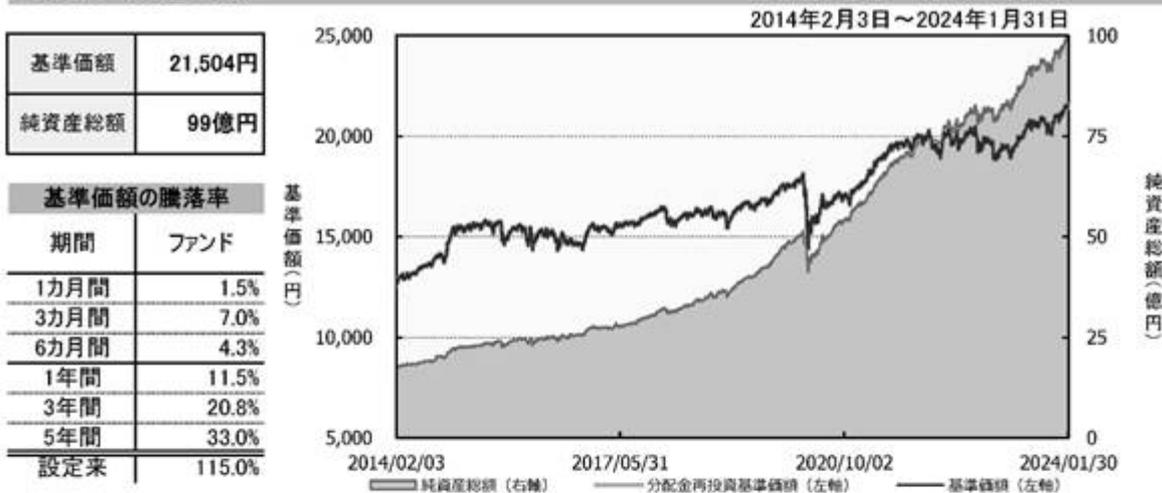
(参考情報) 運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

2024年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月	22年1月	23年1月	24年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	340	24.2%	日本円	50.3%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.5%	
外国債券	969	23.9%	米ドル	27.3%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.5%	
外国リート	67	14.6%	ユーロ	10.5%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%	
国内リート・先物	48	14.5%	英ポンド	3.2%	残存年数	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.4%	
国内株式・先物	89	10.0%	豪ドル	2.8%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	0.4%	
外国株式	166	8.1%	オフショア人民元	2.1%	AAA	81.7%	日本ビルファンド	日本	1.0%
外国優先出資証券	62	1.4%	シンガポール・ドル	1.0%	AA	10.9%	日本プロロジスリート	日本	1.0%
			カナダ・ドル	1.0%	A	6.1%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.9%
			香港ドル	0.4%	BBB	-	GLP投資法人	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.5%	その他	1.4%	BB以下・無格付	1.3%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.8%
合計	1,741	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.8%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しております。

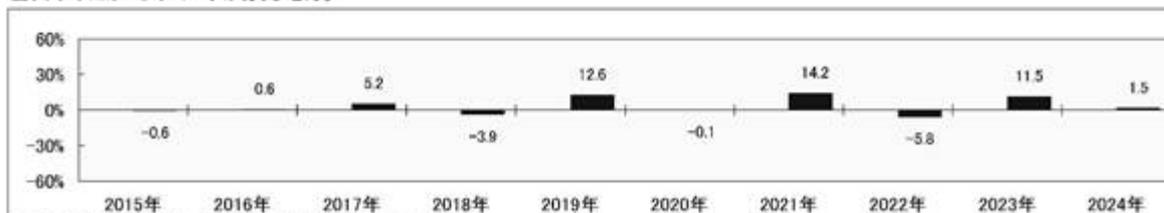
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2024年は1月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

## (1) 【投資状況】 (2024年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,869,188,280	99.12
内 日本	11,869,188,280	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	105,276,702	0.88
純資産総額	11,974,464,982	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】 (2024年1月31日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	399,298,867	4.8750 1,946,581,979	5.1415 2,052,995,124	17.14
2	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	494,315,082	4.0387 1,996,390,329	4.0247 1,989,469,910	16.61
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	558,778,395	3.4431 1,923,969,313	3.4952 1,953,042,246	16.31
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	560,732,827	3.4609 1,940,696,028	3.4395 1,928,640,558	16.11
5	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,577,860,815	1.2320 1,944,068,756	1.2191 1,923,570,119	16.06
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	265,444,862	5.6737 1,506,058,304	5.9788 1,587,041,740	13.25
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	128,177,647	2.8366 363,597,152	2.8901 370,446,217	3.09
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	17,845,252	3.5205 62,825,813	3.5854 63,982,366	0.53

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,724,473,332	2,724,473,332	1.5976	1.5976
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,855,754,201	2,855,754,201	1.5254	1.5254
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
第15計算期間末 (2021年1月12日)	6,484,800,717	6,484,800,717	1.8830	1.8830
第16計算期間末 (2022年1月11日)	8,604,019,799	8,604,019,799	2.1960	2.1960
第17計算期間末 (2023年1月10日)	9,398,811,297	9,398,811,297	2.0999	2.0999
2023年1月末日	9,628,938,358	-	2.1364	-

2月末日	9,824,324,671	-	2.1674	-
3月末日	9,804,699,319	-	2.1330	-
4月末日	10,047,970,137	-	2.1847	-
5月末日	10,317,346,564	-	2.2274	-
6月末日	10,802,270,075	-	2.3177	-
7月末日	10,885,676,202	-	2.3209	-
8月末日	11,140,732,325	-	2.3556	-
9月末日	10,979,024,895	-	2.3202	-
10月末日	10,792,663,668	-	2.2607	-
11月末日	11,413,151,710	-	2.3726	-
12月末日	11,589,571,386	-	2.3954	-
第18計算期間末 (2024年1月10日)	11,710,771,031	11,710,771,031	2.4153	2.4153
2024年1月末日	11,974,464,982	-	2.4519	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第9計算期間	21.1
第10計算期間	4.5
第11計算期間	6.7
第12計算期間	7.9
第13計算期間	6.2
第14計算期間	14.7
第15計算期間	0.3
第16計算期間	16.6
第17計算期間	4.4

第18計算期間	15.0
---------	------

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9計算期間	501,213,562	250,896,906
第10計算期間	501,645,807	334,815,579
第11計算期間	489,108,988	304,974,316
第12計算期間	577,484,738	415,195,786
第13計算期間	682,462,389	295,483,585
第14計算期間	853,612,726	397,196,903
第15計算期間	998,812,762	616,961,375
第16計算期間	906,065,649	431,848,512
第17計算期間	926,048,289	368,363,492
第18計算期間	850,834,868	478,063,755

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

（参考情報）運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

2024年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	24,519円
純資産総額	119億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	2.4%
3か月間	8.5%
6か月間	5.6%
1年間	14.8%
3年間	29.8%
5年間	44.0%
設定来	145.2%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月	22年1月	23年1月	24年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内株式・先物	89	16.6%	日本円	50.3%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.9%
外国リート	67	16.4%	米ドル	29.4%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.8%
国内リート・先物	48	16.0%	ユーロ	8.6%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%
国内債券	340	16.0%	英ポンド	3.2%	残存年数	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
外国債券	969	15.8%	豪ドル	3.0%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	0.7%
外国株式	166	13.5%	オフショア人民元	1.4%	AAA	日本ビルファンド	日本	1.1%
外国優先出資証券	62	2.4%	シンガポール・ドル	1.1%	AA	日本プロジスリート	日本	1.0%
			カナダ・ドル	1.0%	A	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.0%
			スイス・フラン	0.6%	BBB	GLP投資法人	日本	0.9%
コール・ローン、その他		4.0%	その他	1.4%	BB以下・無格付	大和ハウスリート投資法人	日本	0.9%
合計	1,741	-	合計	100.0%	合計	合計		8.7%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しております。

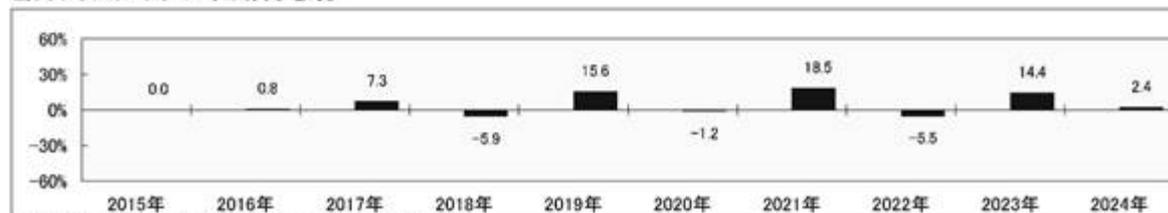
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2024年は1月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】

## (1) 【投資状況】 (2024年1月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,958,169,737	99.13
内 日本	15,958,169,737	99.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	140,810,103	0.87
純資産総額	16,098,979,840	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】 (2024年1月31日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	795,483,527	4.8750 3,877,982,196	5.1415 4,089,978,554	25.41
2	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	789,989,818	4.0387 3,190,531,882	4.0247 3,179,472,020	19.75
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	529,651,585	5.6737 3,005,116,056	5.9788 3,166,680,896	19.67
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	900,649,518	3.4608 3,117,007,673	3.4395 3,097,784,017	19.24
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	223,995,064	3.4434 771,313,052	3.4952 782,907,547	4.86
6	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	633,537,676	1.2320 780,531,095	1.2191 772,345,780	4.80
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	256,441,710	2.8369 727,515,679	2.8901 741,142,186	4.60
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	35,660,941	3.5211 125,566,749	3.5854 127,858,737	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.13%
合計	99.13%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,263,159,704	2,263,159,704	1.6365	1.6365
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,808,604,084	2,808,604,084	1.5507	1.5507
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
第15計算期間末 (2021年1月12日)	7,237,633,493	7,237,633,493	2.0216	2.0216
第16計算期間末 (2022年1月11日)	10,544,787,720	10,544,787,720	2.4728	2.4728
第17計算期間末 (2023年1月10日)	12,038,049,728	12,038,049,728	2.3715	2.3715
2023年1月末日	12,422,668,106	-	2.4298	-

2月末日	12,675,518,343	-	2.4699	-
3月末日	12,566,430,980	-	2.4113	-
4月末日	12,943,714,100	-	2.4848	-
5月末日	13,451,708,199	-	2.5441	-
6月末日	14,228,815,778	-	2.6707	-
7月末日	14,397,771,273	-	2.6934	-
8月末日	14,823,777,338	-	2.7398	-
9月末日	14,658,353,761	-	2.7010	-
10月末日	14,306,939,179	-	2.6173	-
11月末日	15,217,867,924	-	2.7657	-
12月末日	15,461,866,258	-	2.7957	-
第18計算期間末 (2024年1月10日)	15,653,816,556	15,653,816,556	2.8278	2.8278
2024年1月末日	16,098,979,840	-	2.8913	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第9計算期間	24.5
第10計算期間	5.2
第11計算期間	9.2
第12計算期間	11.1
第13計算期間	8.5
第14計算期間	18.5
第15計算期間	0.8
第16計算期間	22.3
第17計算期間	4.1

第18計算期間	19.2
---------	------

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9計算期間	458,619,078	238,638,593
第10計算期間	698,613,794	270,347,551
第11計算期間	433,420,891	252,225,036
第12計算期間	541,348,837	363,638,097
第13計算期間	676,061,653	274,586,229
第14計算期間	898,116,398	365,651,278
第15計算期間	1,060,242,411	584,120,737
第16計算期間	1,096,214,144	412,115,894
第17計算期間	1,255,999,989	444,192,637
第18計算期間	1,000,538,169	541,007,076

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）」の記載と同じ。

—

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

—

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

（参考情報）運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)

2024年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	28,913円
純資産総額	160億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	3.4%
3か月間	10.5%
6か月間	7.3%
1年間	19.0%
3年間	42.7%
5年間	61.2%
設定来	189.1%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月	22年1月	23年1月	24年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	89	24.5%	日本円	50.6%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.3%	
外国株式	166	20.0%	米ドル	31.8%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	1.1%	
外国リート	67	19.5%	ユーロ	6.1%	修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.1%	
国内リート・先物	48	19.1%	豪ドル	3.5%	残存年数	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%	
国内債券	340	4.8%	英ポンド	3.2%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	1.1%	
外国債券	969	4.7%	シンガポール・ドル	1.3%	AAA	81.7%	日本ビルファンド	日本	1.3%
外国優先出資証券	62	3.5%	カナダドル	0.9%	AA	10.9%	日本プロジスリート	日本	1.3%
			スイス・フラン	0.9%	A	6.1%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.2%
			香港ドル	0.5%	BBB	-	GLP投資法人	日本	1.1%
コール・ローン、その他		4.6%	その他	1.2%	BB以下・無格付	1.3%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.1%
合計	1,741	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	11.5%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しております。

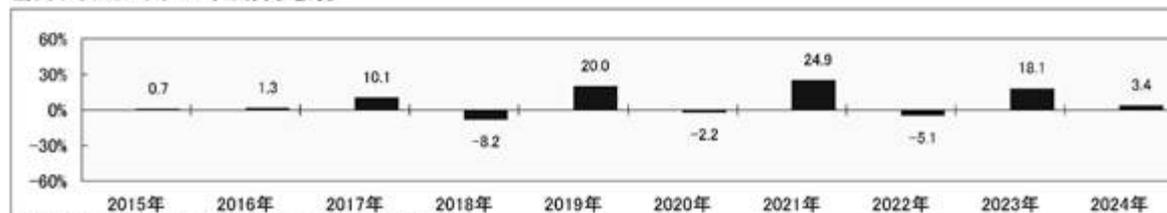
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2024年は1月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（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
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	1.01%	0.99%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	1.18%	1.16%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	1.34%	1.32%	0.02%

※対象期間は2023年1月11日～2024年1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）をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

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

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

・公社債等：原則として次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

#### 信託約款の変更

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

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

##### < 収益分配金にかかる請求権 >

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

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

##### < 償還金にかかる請求権 >

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

##### < 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2023年1月11日から2024年1月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 2023年1月10日現在	第18期 2024年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	111,822,121	137,184,060
親投資信託受益証券	7,908,954,768	9,698,636,002
未収入金	7,728,000	24,000
流動資産合計	8,028,504,889	9,835,844,062
資産合計	8,028,504,889	9,835,844,062
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,710,688	5,928,839
未払受託者報酬	2,221,641	2,595,033
未払委託者報酬	37,768,687	44,116,488
その他未払費用	333,166	389,177
流動負債合計	50,034,182	53,029,537
負債合計	50,034,182	53,029,537
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,418,631,287	1,459,954,586
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,791,839,420	5,191,859,939
（分配準備積立金）	1,307,276,853	1,809,514,203
元本等合計	7,978,470,707	9,782,814,525
純資産合計	7,978,470,707	9,782,814,525
負債純資産合計	8,028,504,889	9,835,844,062

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期		第18期	
	自	2022年1月12日 至 2023年1月10日	自	2023年1月11日 至 2024年1月10日
営業収益				
受取利息		10		33
有価証券売買等損益		297,222,349		1,083,429,234
その他収益		-		248
営業収益合計		297,222,339		1,083,429,515
営業費用				
支払利息		29,425		33,756
受託者報酬		4,291,042		4,913,984
委託者報酬		1 72,949,152		1 83,539,449
その他費用		643,493		736,931
営業費用合計		77,913,112		89,224,120
営業利益又は営業損失( )		375,135,451		994,205,395
経常利益又は経常損失( )		375,135,451		994,205,395
当期純利益又は当期純損失( )		375,135,451		994,205,395
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( )		7,750,923		45,650,904
期首剰余金又は期首欠損金( )		3,734,098,495		3,791,839,420
剰余金増加額又は欠損金減少額		790,757,952		806,786,359
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		790,757,952		806,786,359
剰余金減少額又は欠損金増加額		365,632,499		355,320,331
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		365,632,499		355,320,331
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,791,839,420		5,191,859,939

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第18期
	自2023年1月11日 至2024年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首元本額	3,743,206,897円	4,186,631,287円
期中追加設定元本額	810,744,400円	793,333,632円
期中一部解約元本額	367,320,010円	389,010,333円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	4,186,631,287口	4,590,954,586口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第17期	第18期
	自2022年1月12日 至2023年1月10日	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	9,532,625円	11,029,026円

2. 2 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,045,580,029円）及び分配準備積立金（1,307,276,853円）より分配対象額は4,352,856,882円（1万口当たり10,397.04円）であり、分配を行っております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（612,044,911円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,575,764,791円）及び分配準備積立金（1,197,469,292円）より分配対象額は5,385,278,994円（1万口当たり11,730.19円）であり、分配を行っておりません。</p>
---------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第18期 自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期
	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	300,528,296	1,036,892,155
合計	300,528,296	1,036,892,155

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第17期	第18期
2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第18期
自2023年1月11日
至2024年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	1.9057円	2.1309円
(1万口当たり純資産額)	(19,057円)	(21,309円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	697,303,210	2,400,536,030	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,945,543,488	2,397,493,240	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	369,623,880	1,492,799,964	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	202,460,521	986,995,039	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	134,061,273	760,623,444	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	63,848,184	181,105,373	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	8,674,072	30,536,203	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	418,558,342	1,448,546,709	
親投資信託受益証券 合計			9,698,636,002	
合計			9,698,636,002	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ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」-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、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2023年1月10日現在 金額（円）	2024年1月10日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,518,881,640	5,586,239,986
コール・ローン	1,040,237,697	1,779,830,398
国債証券	230,386,538,826	278,767,121,554
派生商品評価勘定	9,300,270	23,749,517
未収入金	56,398,089	5,886,054
未収利息	1,560,920,037	2,131,044,332
前払費用	71,017,903	96,671,580
流動資産合計	235,643,294,462	288,390,543,421
資産合計	235,643,294,462	288,390,543,421
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,099,477	533,574
未払金	868,871,366	2,559,684,094
未払解約金	161,589,341	262,283,463
流動負債合計	1,031,560,184	2,822,501,131
負債合計	1,031,560,184	2,822,501,131
純資産の部		
元本等		
元本	1 76,916,702,172	82,950,829,216
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	157,695,032,106	202,617,213,074
元本等合計	234,611,734,278	285,568,042,290

純資産合計	234,611,734,278	285,568,042,290
負債純資産合計	235,643,294,462	288,390,543,421

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	75,012,242,987円	76,916,702,172円
期中追加設定元本額	9,101,610,745円	11,582,941,136円
期中一部解約元本額	7,197,151,560円	5,548,814,092円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	444,538,723円	377,492,729円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	9,071,985円	6,497,887円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	50,039,964円	39,219,622円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	19,793,735円	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	242,166,536円	199,072,309円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	376,635,971円	589,685,015円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス エマージングプラ ス(為替ヘッジなし)	600,569,236円	799,591,491円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジな し)	2,747,189,894円	3,798,904,283円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス エ マージングプラス(為替ヘッジ なし)	613,214,846円	840,960,835円
D-I's 外国債券インデック ス	1,286,149円	2,567,249円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	13,305,885円	20,097,217円
iFree 外国債券インデック ス	2,029,809,603円	2,145,133,800円
iFree 8資産バランス	1,898,344,838円	2,307,908,798円
iFree 年金バランス	355,845,642円	503,112,959円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	308,742円

DCダイワ外国債券インデックス	50,822,065,792円	51,483,703,937円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,086,461,266円	1,161,943,603円
ダイワ・ライフ・バランス50	696,780,213円	825,191,730円
ダイワ・ライフ・バランス70	459,259,897円	632,918,511円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	647,312,252円	697,303,210円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	508,972,778円	552,403,507円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	195,815,995円	220,129,859円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	32,292,625円	37,192,357円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	14,308,175円	19,479,417円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,421,852,243円	2,000,377,189円
ダイワつみたてインデックス バランス30	4,055,482円	4,736,673円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,543,536円	2,006,746円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,610,007円	3,352,008円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ラップ専用)	216,598,164円	1,229,463,374円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	119,575,140円	94,521,436円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	37,971,006円	26,095,640円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,260,578,750円	2,770,485,519円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	199,538,920円	173,855,470円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	19,262円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	-円	66,939円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	65,516円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	-円	9,170円

スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	33,755円
スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	11,191円
スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	8,872円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	29,726円
スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	20,301円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	152,390,643円	150,753,681円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	51,334,584円	69,653,991円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	1,753,577,119円	3,243,715,198円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,725,230,060円	5,802,944,505円
ダイワライフスタイル2 5	29,042,461円	26,762,852円
ダイワライフスタイル5 0	60,480,650円	59,413,287円
ダイワライフスタイル7 5	15,241,407円	16,604,183円
計	76,916,702,172円	82,950,829,216円
2. 期末日における受益権の総数	76,916,702,172口	82,950,829,216口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	736,504,999	5,125,093,320
合計	736,504,999	5,125,093,320

（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	2023年1月10日現在				2024年1月10日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	36,373,263	-	37,376,908	1,003,645	112,770,646	-	112,769,791	855
イスラエル・ シュケル	36,373,263	-	37,376,908	1,003,645	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	112,770,646	-	112,769,791	855
買建	841,405,725	-	850,610,163	9,204,438	1,345,156,926	-	1,368,372,014	23,215,088
アメリカ・ドル	82,413,399	-	82,375,071	38,328	-	-	-	-
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	178,129,421	-	182,480,646	4,351,225
イスラエル・ シュケル	-	-	-	-	56,383,155	-	55,849,581	533,574
オーストラリ ア・ドル	26,678,245	-	27,168,575	490,330	-	-	-	-
オフショア・ 人民元	256,298,196	-	261,476,835	5,178,639	1,020,913,817	-	1,038,480,384	17,566,567
カナダ・ドル	151,114,315	-	152,822,662	1,708,347	-	-	-	-
ニュージーラ ンド・ドル	11,472,712	-	11,554,602	81,890	35,967,483	-	36,380,907	413,424
ノルウェー・ クローネ	8,241,330	-	8,183,826	57,504	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	9,472,689	-	9,495,354	22,665	-	-	-	-

メキシコ・ペソ	-	-	-	-	53,763,050	-	55,180,496	1,417,446
ユーロ	295,714,839	-	297,533,238	1,818,399	-	-	-	-
合計	877,778,988	-	887,987,071	8,200,793	1,457,927,572	-	1,481,141,805	23,215,943

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	3.0502円	3.4426円
(1万口当たり純資産額)	(30,502円)	(34,426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	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	883,651.050	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	761,785.050	

5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	778,818.780	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	802,100.460	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,602,627.410	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,238,974.800	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	934,876.250	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	567,382.760	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	543,507.180	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	977,636.530	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,136,324.070	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,103,884.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,240,455.700	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,064,418.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,714,697.860	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,046,890.870	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,473,788.940	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,334,983.320	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,385,761.650	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,420,913.220	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,240,228.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,384,419.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,127,373.720	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,175,907.300	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,297,268.100	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,210,855.660	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,857,680.220	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,910,534.120	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,915,935.080	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,985,394.250	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,887,969.080	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,607,204.220	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,235,820.660	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,574,040.940	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,907,128.300	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,601,684.280	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,488,093.250	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,524,019.410	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,484,240.120	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,618,021.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	532,551.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,605,182.400	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,317,148.360	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,281,800.060	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,072,561.910	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,045,166.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,937,131.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,997,900.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	785,250.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,446,097.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,879,798.900	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,061,824.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,601,360.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,546,059.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,869,595.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,153,555.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,906,150.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,731,316.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,045,009.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,539,394.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,641,545.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,394,990.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,830,777.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,102,016.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,206,200.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,857,763.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,467,533.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,924,760.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,384,095.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,567,434.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,438,600.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,501,108.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,439,925.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,438,950.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,557,328.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,576,966.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,918,310.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,451,940.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,182,814.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,417,275.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,743,362.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,408,875.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,394,125.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,615,096.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,596,073.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,686,124.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,859,000.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,650,424.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,360,825.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,158,748.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,137,660.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,605,624.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,339,625.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,801,940.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,528,919.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,152,700.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,864,920.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,336,450.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,426,750.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,641,112.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,329,750.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,018,285.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,463,776.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	274,128.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,994,808.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,377,725.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,434,400.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,525,000.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,555,496.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,137,200.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	2,934,960.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,166,600.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,107,720.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,825,850.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	6,105,385.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,100,090.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,183,964.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,446,800.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,396,650.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,629,993.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,133,950.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,083,675.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,724,440.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,498,040.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,268,055.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,001,896.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,713,400.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,505,360.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,941,280.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,322,446.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,732,341.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,392,150.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,381,900.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,628,900.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,149,710.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,647,498.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,863,131.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,614,350.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,453,400.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,321,537.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,769,360.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,574,040.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,706,320.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,405,353.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,157,910.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,349,720.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,454,464.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,847,226.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,339,400.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,055,524.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,441,200.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,615,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,459,596.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,391,712.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,894,924.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,486,460.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,380,950.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,396,250.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,576,150.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,413,450.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,209,535.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,240,200.000	

1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,064,610.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,845,120.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,318,040.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,444,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,689,200.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,984,952.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,532,320.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,684,600.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	963,830.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,872,448.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,571,499.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,861,056.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,635,230.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,886,425.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,512,000.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,675,250.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,832,000.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,771,250.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,764,900.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,925,630.000	

2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,549,397.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,927,340.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,884,950.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,295,085.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,839,080.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,877,120.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,636,460.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,908,900.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,906,920.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,852,080.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,922,360.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,933,430.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,894,053.900	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,405,950.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,627,710.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,149,392.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,755,920.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,130,310.400	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,421,425.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,344,180.000	

3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,263,821.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,482,025.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,509,205.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,389,290.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,007,710.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,774,205.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,502,745.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,567,947.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,997,360.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,481,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,981,940.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,395,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,475,920.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,486,725.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,962,500.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,491,990.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,982,900.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	993,480.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,862,300.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,477,915.000	

3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,684,320.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,349,150.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,059,045.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,627,776.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,494,690.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	998,940.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,997,510.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,516,875.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,971,560.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,761,426.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,644,759.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,977,800.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,914,800.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,960,140.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	986,420.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,412,418.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	4,400,000.000	3,972,716.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,347,850.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,961,160.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,582,756.000	

3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,645,203.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,477,635.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,993,190.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,502,775.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,955,210.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,500,665.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	2,000,000.000	2,013,940.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	4,013,720.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,519,460.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	7,000,000.000	6,921,250.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,025,380.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,937,500.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,300,000.000	1,307,007.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,997,870.000	
5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,930,771.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,119,530.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,049,380.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,033,630.000	
5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,008,820.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,553,700.000	

	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,313,736.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,011,950.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,009,800.000	
	4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	2,000,000.000	2,076,940.000	
	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	7,000,000.000	7,273,420.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,848,374.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	1,300,000.000	1,373,320.000	
	4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,258,627.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,800,000.000	3,068,828.000	
	4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,529,785.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,065,130.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,072,160.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,013,500.000	
	アメリカ・ドル 小計		921,390,130.320 (133,315,937,956)	
イギリス・ポ ド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	889,732.050	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	846,440.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,384,483.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,021,187.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,097,650.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	996,586.000	

1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,296,283.500	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,370,415.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	840,454.800	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	731,299.800	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	460,105.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,287,465.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,806,995.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	745,773.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,047,787.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	529,720.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,389,150.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,389,120.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	457,985.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,180,310.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,939,775.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	1,021,400.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,184,300.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	909,342.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,051,490.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,385,160.000	

0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,311,254.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,763,249.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	686,699.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,926,188.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	315,741.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,012,000.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	958,790.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,100,000.000	2,015,748.000	
3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	395,180.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,218,750.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	800,000.000	751,200.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	700,000.000	721,847.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,062,660.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,000,000.000	1,051,300.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,047,790.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,328,928.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,481,273.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,398,379.020	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,446,154.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,672,097.840	

	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,339,485.940	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,256,245.760	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,167,842.000	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,707,680.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,313,695.740	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,451,682.780	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,642,695.600	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,105,790.600	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,575,896.100	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,395,248.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,590,783.660	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,180,262.160	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,342,034.400	
	イギリス・ポンド 小計		77,894,982.450 (14,329,560,971)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,919,178.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,792,672.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,226,860.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,706,202.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,100,432.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,121,472.000	

	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,017,752.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,534,352.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,203,158.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	186,714.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	241,467.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	419,754.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,990,730.000	
	イスラエル・シュケル 小計		19,460,743.000 (754,088,223)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,051,036.910	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,317,983.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,781,764.060	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,329,262.480	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,765,899.520	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,059,653.910	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,140,932.580	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	697,237.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,613,429.840	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,107,555.600	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	987,727.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,432,260.000	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,790,845.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,645,967.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,114,085.000	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,390,030.400	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,169,342.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,645,600.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	801,850.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,497,408.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,996,475.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,101,204.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,325,504.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,184,638.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,163,388.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,038,961.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	946,026.000	
	オーストラリア・ドル 小計		40,096,067.740 (3,881,299,357)	
オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,303,480.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,211,000.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,232,250.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,123,800.000	

3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,296,520.000	
3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,310,000.000	
2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,203,450.000	
2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,636,160.000	
3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,270,540.000	
3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,325,800.000	
3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,167,000.000	
3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,125,370.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,626,994.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,186,690.000	
3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	16,291,940.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,372,592.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,543,020.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,054,900.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,761,030.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,301,350.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,402,730.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,752,900.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,455,170.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,461,342.000	

3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,240,350.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	13,198,200.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,627,160.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,961,995.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	16,441,120.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,019,210.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,313,976.000	
2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	10,015,000.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,278,550.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,004,075.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,089,400.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,060,320.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	4,044,720.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,980,000.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	32,196,480.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,582,745.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,237,496.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,784,840.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,614,785.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,015,480.000	

2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,331,930.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,192,800.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,068,940.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,423,600.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,049,910.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,271,650.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,248,750.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	24,811,710.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,003,360.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	40,353,200.000	
2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	8,968,680.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	33,245,190.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,026,950.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	39,979,200.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	29,924,400.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,108,500.000	
2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	30,000,300.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,145,200.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	11,000,000.000	11,550,330.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,146,200.000	

	2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,156,600.000	
	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	35,000,000.000	35,590,800.000	
	2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,037,440.000	
オフショア・人民元 小計			1,045,757,570.000 (21,059,988,823)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	558,560.200	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,104,685.570	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,343,471.750	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,203,612.080	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,009,011.080	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,008,194.710	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,242,728.130	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,125,747.480	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	921,053.880	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,144,991.200	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	616,180.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,917,766.600	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,162,965.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,057,528.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	675,598.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,728,044.400		

0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,666,280.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,950,039.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	280,494.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,014,848.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,941,761.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,052,446.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,848,525.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	193,120.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,366,155.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,027.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	390,484.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	982,330.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,144,355.500	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	200,938.000	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	297,462.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	590,004.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	577,458.000	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	297,732.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	368,460.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,196,376.000	

	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	494,990.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,002,800.000	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,016,760.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	310,047.000	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,025,180.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,666,051.000	
カナダ・ドル 小計			50,790,261.080 (5,489,919,321)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	786,976.800	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	811,831.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	392,936.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	592,969.280	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	628,125.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,402.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	671,488.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	440,055.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	702,750.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	548,515.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	328,471.500	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	443,340.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	714,007.500	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	551,400.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	411,655.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	191,120.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	235,968.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	650,690.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,520.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	403,064.000	
シンガポール・ドル 小計			10,122,284.580 (1,100,494,779)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,169,514.350	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,544,037.550	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,904,862.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,748,414.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,313,926.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,920,320.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,316,250.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,919,920.000	
スウェーデン・クローナ 小計			38,837,244.300 (548,381,890)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,162,887.500	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,915,409.010	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,770,999.000	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,703,331.400	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,904,175.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	418,635.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,974,280.000	
デンマーク・クローネ 小計			35,849,716.910 (760,372,496)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	601,320.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,380,855.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	392,083.300	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	562,878.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	432,405.800	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	222,232.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	923,362.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	455,360.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	363,765.600	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	258,951.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	622,022.400	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	193,864.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	502,830.000	
ニュージーランド・ドル 小計			6,911,929.600 (623,456,050)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,266,545.050	

	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,161,409.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,238,714.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,322,200.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,541,230.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,244,352.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,005,205.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,545,215.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,619,525.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,452,855.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		34,397,250.050 (480,873,555)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,147,732.740	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,948,131.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,346,658.800	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,900,780.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,388,090.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,947,858.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,408,788.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	485,025.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,532,750.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,382,520.000	

	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,326,700.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	860,154.430	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,374,461.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,487,794.320	
	ポーランド・ズロチ 小計		40,537,444.490 (1,474,772,499)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,364,979.260	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,224,377.860	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,543,038.520	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,332,513.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,317.310	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,417,738.770	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,890,149.200	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,425,918.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,751,052.330	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,240,593.600	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	992,802.900	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,566,461.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,201,114.600	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,091,667.500	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,208,304.000	

	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,278,588.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,189,480.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,838.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,328,179.700	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,320,156.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,287,117.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,674,137.500	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,557,541.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,667,574.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,371,090.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,038,054.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,250.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	718,732.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	995,990.000	
	マレーシア・リングgit 小計		42,590,755.550 (1,324,031,595)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,395,550.200	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,881,385.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,248,550.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	948,480.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,306,280.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	8,995,400.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,816,070.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,610,250.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,697,300.000	

	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,452,414.080	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,504,941.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,819,285.680	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,898,664.080	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	41,293,894.600	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	25,861,549.940	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,196,469.600	
メキシコ・ペソ 小計			255,926,484.580 (2,181,978,022)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	320,374.600	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	270,563.040	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	774,067.060	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	265,435.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	745,080.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	401,929.900	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	456,905.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	447,825.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	222,235.900	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	258,520.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	422,520.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	188,832.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	497,040.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	186,870.000	

0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	286,992.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	728,504.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	260,433.900	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	390,400.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	307,092.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,018,320.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,338,194.450	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,072,368.620	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	584,589.600	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	143,217.600	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,200,678.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	399,340.800	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,118,292.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,158,054.400	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	840,908.600	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	703,428.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	243,760.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	150,545.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	997,920.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	462,571.200	

0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	429,600.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	136,179.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	266,508.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,306,155.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	237,459.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	295,914.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	303,936.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	303,798.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,021,020.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	839,648.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,648,692.610	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,584,182.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	916,947.440	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,409,585.870	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	912,872.080	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	563,443.400	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,040,545.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	460,856.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	497,778.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,389,737.900	

1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	575,152.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,383,120.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	507,654.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,046,918.600	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	561,098.400	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,095,816.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,308,640.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	224,963.800	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,156,442.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	520,160.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	384,084.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,530,915.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	596,346.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	724,038.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,332,247.200	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,445,481.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,056,134.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,401,876.100	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,716,121.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,842,664.300	

4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,867,237.880	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,636,401.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,283,585.240	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,207,346.540	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,832,850.800	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,713,291.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,133,533.360	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,076,808.800	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,001,405.040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,281,188.800	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,955,812.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,113,748.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,737,691.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,781,288.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,773,763.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,290,207.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,674,350.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,527,657.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,544,830.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,625,925.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,843,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,572,444.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,049,772.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	778,401.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,052,912.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,810,200.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	592,427.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,079,332.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	599,221.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,211,570.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,331,152.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,611,305.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,700,000.000	1,482,995.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,199,136.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,600,000.000	1,620,080.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,722,185.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	874,770.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	900,000.000	932,319.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,527,285.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,071,945.000	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,490,910.000	
2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	998,920.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,614.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,757.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,314,104.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,197,765.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	95,764.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,085,578.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,630,516.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	93,120.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,909,130.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	418,024.500	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	100,228.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,211.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,193,795.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,813,441.570	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,008,321.240	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,153,228.330	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,024,913.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,666,571.760	

4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,775,885.960	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,992,767.370	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,718,883.540	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,960,349.600	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,144,448.640	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,094,020.060	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,378,510.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,943,481.120	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,775,219.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,180,372.300	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,465,773.080	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	952,328.070	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,799,912.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,184,165.900	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,240,200.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,049,690.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,026,050.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,422,517.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,569,741.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,007,568.500	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,833,083.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,175,808.700	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,642,660.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,532,807.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,840,550.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,483,592.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,219,300.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	584,822.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	912,435.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,773,472.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,871,809.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,408,030.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,908,008.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	2,028,726.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,755,050.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,016,888.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,566,000.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	908,210.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	2,004,156.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	2,200,000.000	2,196,788.000	

3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	2,200,000.000	2,260,368.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	1,600,000.000	1,621,376.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	700,000.000	747,327.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,273,948.720	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,010,668.400	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,992,828.110	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,474,004.120	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,964,744.370	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,725,109.110	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,847,747.340	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,083,906.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,259,955.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,072,656.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	650,313.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,203,244.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	745,608.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	615,475.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,090,336.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	621,891.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	801,819.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	94,986.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	511,800.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	900,000.000	783,360.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	900,558.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,310,088.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	652,086.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,236,318.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,684,996.080	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,290,768.420	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,429,600.040	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,786,514.100	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,835,897.540	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,249,843.000	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,309,982.040	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,926,131.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,017,387.480	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	693,184.800	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,347,075.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,470,513.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,451,736.000	

2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,611,548.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,137,929.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,013,900.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,270,581.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,507,211.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,535,352.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,206,855.600	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	650,000.000	604,883.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,859,835.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,054,955.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,092,975.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,685,471.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,259,596.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,206,015.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,111,443.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,139,985.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,471,080.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,711,300.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,867,278.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,041,248.000	

0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,614,728.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,065,645.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,588,970.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	721,260.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	483,805.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,688,929.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,454,634.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,367,058.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,029,237.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	275,793.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	711,672.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,563,149.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,873,638.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,376,864.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	783,666.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	523,952.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	282,465.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	484,975.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	780,664.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,461,296.000	

3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,089,734.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	196,956.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	504,870.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,329,436.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,952,712.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	307,695.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,515,840.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	101,746.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	507,905.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	400,316.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	508,570.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	928,143.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,218,672.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,199,897.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	718,235.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	408,508.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	302,235.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	413,188.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,547,880.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	623,466.000	

5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,589,096.920	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,314,783.010	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,088,601.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,528,765.160	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,743,589.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,230,801.160	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,156,611.140	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,450,769.090	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,132,431.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,571,783.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,922,251.380	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,337,146.680	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,914,046.700	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,287,065.760	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,839,387.000	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,040,699.660	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	857,789.400	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	696,516.890	

3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	759,437.550	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,058,001.890	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	961,336.350	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	789,581.100	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,036,367.780	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	483,103.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	753,248.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	673,140.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	697,725.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	889,960.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	441,198.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	273,910.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	465,425.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	691,120.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	664,008.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	274,140.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	83,348.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	203,424.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	927,093.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,547,261.160	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	915,110.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	392,093.520	

3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	733,960.680	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	744,755.160	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	678,012.170	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	393,738.020	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	386,820.940	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,055,369.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,005,551.950	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,942,587.360	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,164,380.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,681,182.320	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,713,973.120	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,397,170.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,530,270.400	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,827,800.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,641,570.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,957,893.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,273,016.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,836,670.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,738,441.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,498,176.000	

1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,943,437.500	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,473,744.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,219,724.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,417,125.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	757,680.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,246,232.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,160,744.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	909,389.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	471,990.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,798,016.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	312,786.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,242,700.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,372,351.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,578,292.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	389,694.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	828,765.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,749,615.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,068,800.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,848.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	988,020.000	

	2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,635,417.000	
	3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	966,170.000	
	3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,505,190.000	
	2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,299,632.000	
	3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	831,168.000	
	3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,549,605.000	
	3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	620,976.000	
	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,626,501.230	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,907,545.160	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,157,416.700	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,254,389.260	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,857,135.270	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,112,807.300	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,960,735.200	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,574,829.660	
	ユーロ 小計		578,014,955.870 (91,441,966,017)	
	国債証券 合計		278,767,121,554 [278,767,121,554]	
	合計		278,767,121,554 [278,767,121,554]	

(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 275銘柄	100%	47.7%
イギリス・ポンド	国債証券 59銘柄	100%	5.1%
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.4%
オフショア・人民元	国債証券 67銘柄	100%	7.6%
カナダ・ドル	国債証券 42銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券 29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 369銘柄	100%	32.8%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年1月10日現在 金額（円）	2024年1月10日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	194,868,389	156,294,397
国債証券	38,233,810,170	46,031,468,030

地方債証券		1,429,751,600	3,079,923,560
特殊債券		718,256,200	1,319,842,088
社債券		1,276,323,100	3,381,227,600
未収利息		52,671,029	67,686,377
前払費用		1,285,012	2,988,435
流動資産合計		41,906,965,500	54,039,430,487
資産合計		41,906,965,500	54,039,430,487
負債の部			
流動負債			
未払金		-	104,588,000
未払解約金		20,206,575	14,402,676
流動負債合計		20,206,575	118,990,676
負債合計		20,206,575	118,990,676
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,357,539,560	43,756,341,643
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,529,219,365	10,164,098,168
元本等合計		41,886,758,925	53,920,439,811
純資産合計		41,886,758,925	53,920,439,811
負債純資産合計		41,906,965,500	54,039,430,487

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	29,034,289,083円	34,357,539,560円
期中追加設定元本額	6,199,700,919円	10,220,051,608円
期中一部解約元本額	876,450,442円	821,249,525円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専用)	1,590,144,831円	2,816,974,771円
iFree 日本債券インデックス	3,689,758,964円	3,281,272,172円
iFree 8資産バランス	4,785,631,215円	6,418,567,518円
ダイワ・ライフ・バランス30	9,984,415,766円	11,900,322,784円
ダイワ・ライフ・バランス50	6,969,138,828円	9,222,584,678円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,307,175,970円	3,538,657,517円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,630,806,680円	1,945,543,488円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,279,480,111円	1,541,689,326円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	490,703,172円	614,822,767円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,294,154,625円	2,152,985,954円
ダイワつみたてインデックスバランス30	36,787,697円	48,479,531円
ダイワつみたてインデックスバランス50	15,311,192円	22,428,230円
ダイワつみたてインデックスバランス70	13,026,438円	18,714,833円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	213,856,456円	189,379,979円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	57,147,615円	43,918,095円
計	34,357,539,560円	43,756,341,643円
2. 期末日における受益権の総数	34,357,539,560口	43,756,341,643口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	666,375,170	339,986,150
地方債証券	11,831,900	12,748,567
特殊債券	4,361,400	1,897,788
社債券	11,356,600	15,504,400

合計	693,925,070	370,136,905
----	-------------	-------------

(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

2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	1.2191円	1.2323円
(1万口当たり純資産額)	(12,191円)	(12,323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	445 2年国債	110,000,000	110,074,800	
	446 2年国債	400,000,000	400,292,000	
	447 2年国債	90,000,000	90,065,700	
	448 2年国債	70,000,000	70,045,500	
	449 2年国債	300,000,000	300,165,000	
	451 2年国債	20,000,000	20,010,800	
	452 2年国債	110,000,000	110,035,200	
	453 2年国債	60,000,000	60,010,200	
	455 2年国債	70,000,000	70,006,300	
	143 5年国債	900,000,000	901,602,000	
	144 5年国債	800,000,000	801,432,000	
	145 5年国債	1,070,000,000	1,072,075,800	
	146 5年国債	540,000,000	541,096,200	
	147 5年国債	800,000,000	800,000,000	
	148 5年国債	550,000,000	549,928,500	
	149 5年国債	650,000,000	649,733,500	
	150 5年国債	560,000,000	559,585,600	

151 5年国債	450,000,000	449,496,000	
152 5年国債	150,000,000	150,285,000	
153 5年国債	270,000,000	269,489,700	
154 5年国債	520,000,000	520,379,600	
155 5年国債	90,000,000	90,705,600	
156 5年国債	600,000,000	602,352,000	
157 5年国債	60,000,000	60,174,600	
158 5年国債	430,000,000	429,462,500	
159 5年国債	200,000,000	199,514,000	
161 5年国債	400,000,000	402,464,000	
162 5年国債	180,000,000	180,919,800	
1 40年国債	30,000,000	35,484,300	
2 40年国債	48,000,000	54,641,280	
3 40年国債	19,000,000	21,602,050	
4 40年国債	54,000,000	61,299,180	
5 40年国債	61,000,000	66,515,010	
6 40年国債	68,000,000	72,563,480	
7 40年国債	41,000,000	41,749,480	
8 40年国債	40,000,000	37,746,400	
9 40年国債	40,000,000	27,630,000	
10 40年国債	240,000,000	194,316,000	
11 40年国債	85,000,000	66,032,250	
12 40年国債	99,000,000	68,401,080	
13 40年国債	252,000,000	172,282,320	
14 40年国債	273,000,000	199,011,540	
15 40年国債	250,000,000	200,650,000	
16 40年国債	370,000,000	324,874,800	
338 10年国債	80,000,000	80,427,200	
339 10年国債	165,000,000	166,008,150	
340 10年国債	190,000,000	191,331,900	
341 10年国債	15,000,000	15,088,650	
342 10年国債	140,000,000	140,289,800	
343 10年国債	300,000,000	300,657,000	
344 10年国債	90,000,000	90,193,500	
345 10年国債	410,000,000	410,840,500	
346 10年国債	250,000,000	250,475,000	
347 10年国債	690,000,000	690,945,300	
348 10年国債	430,000,000	430,313,900	
349 10年国債	430,000,000	430,000,000	

350 10年国債	400,000,000	399,500,000	
351 10年国債	170,000,000	169,586,900	
352 10年国債	390,000,000	388,365,900	
353 10年国債	520,000,000	517,327,200	
354 10年国債	280,000,000	278,348,000	
355 10年国債	290,000,000	288,129,500	
356 10年国債	440,000,000	436,783,600	
357 10年国債	420,000,000	416,434,200	
358 10年国債	600,000,000	594,150,000	
359 10年国債	240,000,000	237,266,400	
360 10年国債	500,000,000	493,275,000	
361 10年国債	510,000,000	501,870,600	
362 10年国債	550,000,000	539,792,000	
363 10年国債	460,000,000	450,192,800	
364 10年国債	450,000,000	439,105,500	
365 10年国債	410,000,000	398,995,600	
366 10年国債	600,000,000	587,226,000	
367 10年国債	330,000,000	322,245,000	
368 10年国債	400,000,000	389,516,000	
369 10年国債	500,000,000	498,715,000	
370 10年国債	550,000,000	547,591,000	
371 10年国債	480,000,000	472,478,400	
372 10年国債	390,000,000	397,686,900	
2 30年国債	9,000,000	10,170,540	
3 30年国債	4,000,000	4,510,000	
4 30年国債	8,000,000	9,397,600	
5 30年国債	8,000,000	9,057,680	
6 30年国債	9,000,000	10,367,280	
7 30年国債	12,000,000	13,787,160	
10 30年国債	25,000,000	26,236,750	
11 30年国債	9,000,000	9,933,030	
12 30年国債	11,000,000	12,562,770	
13 30年国債	11,000,000	12,467,950	
14 30年国債	22,000,000	25,826,020	
15 30年国債	21,000,000	24,907,050	
16 30年国債	26,000,000	30,885,140	
17 30年国債	17,000,000	20,038,410	
18 30年国債	20,000,000	23,392,400	
19 30年国債	15,000,000	17,550,900	

20	30年国債	16,000,000	19,101,760	
21	30年国債	16,000,000	18,748,480	
22	30年国債	17,000,000	20,333,020	
23	30年国債	16,000,000	19,141,920	
24	30年国債	15,000,000	17,968,800	
25	30年国債	17,000,000	19,966,670	
26	30年国債	32,000,000	38,016,320	
27	30年国債	32,000,000	38,451,200	
28	30年国債	34,000,000	40,869,020	
29	30年国債	43,000,000	51,136,460	
30	30年国債	56,000,000	65,771,440	
31	30年国債	76,000,000	88,129,600	
32	30年国債	45,000,000	52,781,850	
33	30年国債	95,000,000	106,905,400	
34	30年国債	110,000,000	126,755,200	
35	30年国債	120,000,000	134,400,000	
36	30年国債	138,000,000	154,249,500	
37	30年国債	165,000,000	181,523,100	
38	30年国債	250,000,000	270,232,500	
39	30年国債	105,000,000	115,132,500	
40	30年国債	80,000,000	86,270,400	
41	30年国債	80,000,000	84,798,400	
42	30年国債	100,000,000	105,888,000	
43	30年国債	105,000,000	111,063,750	
44	30年国債	155,000,000	163,773,000	
45	30年国債	125,000,000	127,436,250	
46	30年国債	170,000,000	173,060,000	
47	30年国債	135,000,000	139,681,800	
48	30年国債	145,000,000	144,398,250	
49	30年国債	120,000,000	119,298,000	
50	30年国債	170,000,000	149,443,600	
51	30年国債	155,000,000	121,030,200	
52	30年国債	150,000,000	122,430,000	
53	30年国債	130,000,000	108,275,700	
54	30年国債	140,000,000	121,675,400	
55	30年国債	140,000,000	121,321,200	
56	30年国債	160,000,000	138,248,000	
57	30年国債	135,000,000	116,305,200	
58	30年国債	210,000,000	180,387,900	

59	30年国債	110,000,000	91,960,000	
60	30年国債	150,000,000	131,067,000	
61	30年国債	110,000,000	91,213,100	
62	30年国債	135,000,000	105,869,700	
63	30年国債	140,000,000	106,356,600	
64	30年国債	120,000,000	90,806,400	
65	30年国債	125,000,000	94,303,750	
66	30年国債	175,000,000	131,395,250	
67	30年国債	140,000,000	110,698,000	
68	30年国債	140,000,000	110,307,400	
69	30年国債	161,000,000	130,049,360	
70	30年国債	166,000,000	133,643,280	
71	30年国債	130,000,000	104,309,400	
72	30年国債	203,000,000	162,485,260	
73	30年国債	140,000,000	111,785,800	
74	30年国債	155,000,000	133,941,700	
75	30年国債	160,000,000	148,872,000	
76	30年国債	120,000,000	114,268,800	
77	30年国債	195,000,000	194,613,900	
78	30年国債	150,000,000	142,612,500	
79	30年国債	160,000,000	144,587,200	
80	30年国債	130,000,000	135,642,000	
75	20年国債	14,000,000	14,357,280	
76	20年国債	25,000,000	25,578,500	
78	20年国債	17,000,000	17,470,730	
79	20年国債	14,000,000	14,407,820	
81	20年国債	65,000,000	67,214,550	
82	20年国債	28,000,000	29,001,280	
85	20年国債	31,000,000	32,419,490	
86	20年国債	6,000,000	6,301,020	
87	20年国債	35,000,000	36,679,300	
88	20年国債	33,000,000	34,842,060	
89	20年国債	15,000,000	15,800,700	
92	20年国債	60,000,000	63,647,400	
93	20年国債	18,000,000	19,122,660	
94	20年国債	45,000,000	47,949,750	
95	20年国債	30,000,000	32,305,800	
96	20年国債	63,000,000	67,409,370	
97	20年国債	25,000,000	26,955,000	

98 20年国債	64,000,000	68,769,280	
99 20年国債	53,000,000	57,170,570	
100 20年国債	35,000,000	38,024,350	
101 20年国債	18,000,000	19,705,320	
102 20年国債	10,000,000	10,992,000	
103 20年国債	21,000,000	22,990,590	
104 20年国債	64,000,000	69,502,080	
105 20年国債	38,000,000	41,383,520	
106 20年国債	16,000,000	17,499,040	
107 20年国債	40,000,000	43,728,000	
108 20年国債	68,000,000	73,671,880	
109 20年国債	60,000,000	65,218,800	
110 20年国債	27,000,000	29,625,480	
111 20年国債	35,000,000	38,745,000	
112 20年国債	40,000,000	44,064,800	
113 20年国債	70,000,000	77,395,500	
114 20年国債	45,000,000	49,916,250	
115 20年国債	42,000,000	46,834,200	
116 20年国債	27,000,000	30,216,510	
117 20年国債	77,000,000	85,704,080	
118 20年国債	13,000,000	14,427,790	
119 20年国債	23,000,000	25,234,910	
120 20年国債	98,000,000	106,247,680	
123 20年国債	42,000,000	47,091,240	
124 20年国債	100,000,000	111,443,000	
125 20年国債	25,000,000	28,261,750	
126 20年国債	21,000,000	23,437,050	
127 20年国債	110,000,000	121,994,400	
128 20年国債	32,000,000	35,531,200	
129 20年国債	95,000,000	104,796,400	
130 20年国債	110,000,000	121,489,500	
131 20年国債	150,000,000	164,548,500	
132 20年国債	25,000,000	27,448,000	
133 20年国債	150,000,000	165,840,000	
134 20年国債	15,000,000	16,605,300	
135 20年国債	20,000,000	21,982,400	
136 20年国債	180,000,000	196,419,600	
137 20年国債	18,000,000	19,804,860	
139 20年国債	250,000,000	273,037,500	

140 20年国債	100,000,000	110,131,000	
141 20年国債	140,000,000	154,309,400	
142 20年国債	210,000,000	233,259,600	
143 20年国債	100,000,000	109,420,000	
144 20年国債	50,000,000	54,272,000	
145 20年国債	40,000,000	44,146,800	
146 20年国債	160,000,000	176,683,200	
147 20年国債	240,000,000	262,756,800	
148 20年国債	290,000,000	314,751,500	
149 20年国債	310,000,000	336,415,100	
150 20年国債	280,000,000	300,840,400	
151 20年国債	280,000,000	294,674,800	
152 20年国債	285,000,000	299,626,200	
153 20年国債	275,000,000	291,700,750	
154 20年国債	305,000,000	319,749,800	
155 20年国債	400,000,000	409,608,000	
156 20年国債	220,000,000	209,530,200	
157 20年国債	310,000,000	286,846,100	
158 20年国債	285,000,000	272,947,350	
159 20年国債	300,000,000	290,073,000	
160 20年国債	280,000,000	273,397,600	
161 20年国債	220,000,000	211,327,600	
162 20年国債	270,000,000	258,549,300	
163 20年国債	230,000,000	219,415,400	
164 20年国債	300,000,000	281,187,000	
165 20年国債	220,000,000	205,473,400	
166 20年国債	320,000,000	306,329,600	
167 20年国債	260,000,000	240,754,800	
168 20年国債	250,000,000	227,080,000	
169 20年国債	230,000,000	204,635,600	
170 20年国債	255,000,000	225,889,200	
171 20年国債	150,000,000	132,201,000	
172 20年国債	275,000,000	245,346,750	
173 20年国債	230,000,000	204,175,600	
174 20年国債	340,000,000	300,298,200	
175 20年国債	195,000,000	174,310,500	
176 20年国債	245,000,000	217,925,050	
177 20年国債	190,000,000	165,338,000	
178 20年国債	335,000,000	295,600,650	

	179 20年国債	210,000,000	184,487,100	
	180 20年国債	250,000,000	230,932,500	
	181 20年国債	220,000,000	206,144,400	
	182 20年国債	230,000,000	222,580,200	
	183 20年国債	190,000,000	192,886,100	
	184 20年国債	170,000,000	163,647,100	
	185 20年国債	180,000,000	172,803,600	
	186 20年国債	220,000,000	225,834,400	
	1 フィリピン共和国	100,000,000	99,282,000	
	国債証券 合計		46,031,468,030	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	100,509,000	
	797 東京都公債	100,000,000	98,225,700	
	32 東京都5年	100,000,000	99,897,800	
	27-15 北海道公債	100,000,000	100,196,300	
	3-5 北海道公債	100,000,000	97,114,400	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,851,600	
	401 大阪府公債	100,000,000	100,668,300	
	457 大阪府公債	100,000,000	98,008,000	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	100,611,200	
	11兵庫県公債20年	100,000,000	109,207,300	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	99,911,000	
	24-1 広島県20年	100,000,000	108,913,900	
	1 埼玉県15年	100,000,000	103,335,200	
	9 埼玉県20年	100,000,000	110,996,600	
	22-1 福岡県15年	100,000,000	102,927,100	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	100,076,000	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	132,952,560	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	97,156,300	
	151 共同発行地方	100,000,000	100,658,000	
	168 共同発行地方	100,000,000	100,181,600	
	244 共同発行地方	100,000,000	98,922,800	
	3-3 堺市公債	100,000,000	96,506,300	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	97,947,800	
	27-1 滋賀県公債	100,000,000	100,709,100	
	2-1 静岡市公債	100,000,000	97,890,400	
	11 名古屋市20年	100,000,000	110,298,100	
10 京都市20年	100,000,000	109,481,000		
2-2 横浜市公債	100,000,000	98,144,900		

	6 札幌市20年	100,000,000	110,250,400	
	2-1 千葉市公債	100,000,000	98,374,900	
地方債証券 合計			3,079,923,560	
特殊債券	47日本政策投資CO	100,000,000	103,472,800	
	174 日本政策投資	100,000,000	98,948,200	
	81 政保道路機構	100,000,000	109,658,000	
	235 政保道路機構	100,000,000	104,588,000	
	241 政保道路機構	100,000,000	100,519,800	
	261 政保道路機構	100,000,000	100,599,700	
	3 地方公共団15年	100,000,000	103,561,100	
	F231地方公共団体	100,000,000	104,072,300	
	129 地方公共団体	100,000,000	97,519,300	
	127 都市再生	100,000,000	99,711,100	
	80 住宅支援機構	100,000,000	103,777,000	
	47 住宅機構RMBS	185,940,000	193,414,788	
特殊債券 合計			1,319,842,088	
社債券	20 成田国際空港	100,000,000	99,530,900	
	101 中日本高速道	200,000,000	200,152,400	
	32大和ハウス工業	100,000,000	100,100,200	
	22 積水ハウス	100,000,000	99,695,600	
	11サントリーホールディング	100,000,000	99,739,400	
	11 ヒューリック	100,000,000	99,974,000	
	29 東急不動産HD	100,000,000	99,592,700	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,889,900	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	101,644,000	
	35 東レ	100,000,000	101,430,200	
	32 住友電工	100,000,000	99,604,400	
	16 クボタ	100,000,000	100,043,500	
	17 パナソニック	100,000,000	100,170,100	
	31 トヨタ自動車	100,000,000	98,495,600	
	6 楽天カード	100,000,000	91,318,200	
	26 りそなホールディング	100,000,000	99,877,200	
	36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,760,200	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	96,302,900	
	81 ホンダファイナンス	100,000,000	99,834,300	
	42 リコーリース	100,000,000	99,693,200	
	214 オリックス	100,000,000	95,968,200	
	1 SOMPOHD	100,000,000	99,975,600	
7 三井住友海上	100,000,000	99,751,900		

82 三井不動産	100,000,000	99,605,000	
80 三菱地所	100,000,000	106,307,900	
143 三菱地所	100,000,000	99,603,900	
9 ソフトバンク	100,000,000	98,641,900	
497 関西電力	100,000,000	101,175,600	
448 中国電力	100,000,000	98,475,100	
489 九州電力	100,000,000	97,973,200	
16 JERA	100,000,000	100,066,800	
65 東京瓦斯	100,000,000	97,138,800	
50 大阪瓦斯	100,000,000	99,694,800	
社債券 合計		3,381,227,600	
合計		53,812,461,278	

## 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

	2023年1月10日現在 金額（円）	2024年1月10日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,769,322,727	1,241,018,074
コール・ローン	1,140,163,619	446,351,253
投資証券	85,471,341,765	92,628,742,072
派生商品評価勘定	119,040	330,359
未収入金	80,683,124	831,692,905
未収配当金	336,694,099	309,942,625
流動資産合計	88,798,324,374	95,458,077,288
資産合計	88,798,324,374	95,458,077,288
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	-	17,911
未払金	-	488,150,700
未払解約金	-	112,506,000
流動負債合計	-	600,674,611
負債合計	-	600,674,611
純資産の部		
元本等		
元本	1	26,103,872,416
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		62,694,451,958
元本等合計		88,798,324,374
純資産合計		88,798,324,374
負債純資産合計		88,798,324,374
		95,458,077,288

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	27,937,030,793円	26,103,872,416円
期中追加設定元本額	2,056,719,172円	1,261,999,814円
期中一部解約元本額	3,889,877,549円	3,878,617,475円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
グローバルREIT・オープン	827,530円	819,018円
（適格機関投資家専用）		
ダイワ・グローバルREIT・	20,761,785,781円	17,922,752,716円
オープン（毎月分配型）		
ダイワ・バランス3資産（外	21,910,958円	-円
債・海外リート・好配当日本		
株）		
安定重視ポートフォリオ（奇数	10,398,209円	11,100,855円
月分配型）		

インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	8,387,412円	7,365,034円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	40,981,474円	38,965,335円
6資産バランスファンド(分配型)	73,723,724円	68,889,294円
6資産バランスファンド(成長型)	211,607,553円	210,156,008円
りそな ワールド・リート・ファンド	946,777,236円	866,670,760円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	20,521,015円	18,385,432円
常陽3分法ファンド	92,469,284円	83,547,273円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	24,349,056円	21,447,139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)	44,844,802円	38,640,288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)	574,878,846円	616,941,568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)	651,326,783円	863,141,092円
ダイワ・グローバルREIT・オープン(為替ヘッジなし/奇数月決算型)	-円	764,177円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	350,726,914円	369,623,880円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	459,562,052円	497,326,936円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	708,970,209円	794,616,101円
グローバルREITファンド 2021-07(適格機関投資家専用)	832,945,758円	819,897,304円
ライフハーモニー(ダイワ世界 資産分散ファンド)(分配型)	222,715,768円	197,056,157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)	18,862,214円	14,893,887円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	25,299,838円	24,254,501円

計	26,103,872,416円	23,487,254,755円
2. 期末日における受益権の総数	26,103,872,416口	23,487,254,755口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	4,008,201,930	6,085,117,537
合計	4,008,201,930	6,085,117,537

（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	2023年1月10日現在				2024年1月10日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	62,414,829	-	62,410,988	3,841	342,992,358	-	342,700,077	292,281
アメリカ・ドル	-	-	-	-	323,693,581	-	323,403,652	289,929
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	19,298,777	-	19,296,425	2,352
ユーロ	62,414,829	-	62,410,988	3,841	-	-	-	-
買建	62,414,829	-	62,530,028	115,199	53,418,358	-	53,438,525	20,167
アメリカ・ドル	62,414,829	-	62,530,028	115,199	19,298,777	-	19,280,866	17,911
イギリス・ポンド	-	-	-	-	34,119,581	-	34,157,659	38,078

合計	124,829,658	-	124,941,016	119,040	396,410,716	-	396,138,602	312,448
----	-------------	---	-------------	---------	-------------	---	-------------	---------

## (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。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	3.4017円	4.0387円
(1万口当たり純資産額)	(34,017円)	(40,387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	199,035	28,292,825.250	
		EQUINIX INC	20,453	16,335,606.570	
		AMERICAN TOWER CORP	35,376	7,494,759.360	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	301,022	5,972,276.480	
		KIMCO REALTY CORP	461,486	9,571,219.640	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	588,714	10,190,639.340	

	INVITATION HOMES INC	667,633	22,632,758.700	
	AMERICOLD REALTY TRUST	314,371	9,471,998.230	
	VICI PROPERTIES INC	376,758	11,924,390.700	
	APARTMENT INCOME REIT CO	98,171	3,437,948.420	
	STAG INDUSTRIAL INC	24,659	951,344.220	
	DIGITAL CORE REIT UNITS	12,723,056	8,269,986.400	
	IRON MOUNTAIN INC	166,837	11,201,436.180	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,452	2,911,296.840	
	SUN COMMUNITIES INC	104,747	14,148,177.290	
	PROLOGIS INC	245,521	32,671,479.470	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	31,923	3,131,646.300	
	SITE CENTERS CORP	110,954	1,486,783.600	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	8,929	1,626,595.930	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,870	6,908,415.600	
	WELLTOWER INC	321,426	28,796,555.340	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	101,201	2,335,719.080	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	48,221	6,383,978.190	
	REALTY INCOME CORP	347,912	20,627,702.480	
	PUBLIC STORAGE	13,946	4,140,567.400	
	UDR INC	251,849	9,603,002.370	
	WP CAREY INC	145,373	9,712,370.130	
	AGREE REALTY CORP	44,816	2,848,056.800	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	173,901	23,236,651.620	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	109,819	17,354,696.570	
アメリカ・ドル 小計			333,670,884.500 (48,278,840,278)	
イギリス・ポンド	LXI REIT PLC	2,924,485	3,032,690.940	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,257,214	8,765,296.000	
	SEGRO PLC	1,309,167	11,381,897.890	
	UNITE GROUP PLC/THE	603,371	6,269,024.690	
	BRITISH LAND CO PLC	968,970	3,865,221.330	
	WORKSPACE GROUP PLC	297,117	1,595,518.290	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	523,548	4,463,246.700	
	BIG YELLOW GROUP PLC	350,341	4,060,452.190	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	177,173	326,529.830	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,014,286	8,298,643.330	
イギリス・ポンド 小計			52,058,521.190 (9,576,685,558)	

オーストラリア・ドル	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	2,857,845	3,886,669.200	
	NATIONAL STORAGE REIT	4,934,999	10,807,647.810	
	GPT GROUP	3,136,794	14,178,308.880	
	MIRVAC GROUP	5,469,190	11,102,455.700	
	STOCKLAND	4,192,433	18,362,856.540	
	GOODMAN GROUP	2,371,559	57,486,590.160	
	CHARTER HALL GROUP	1,441,127	16,385,613.990	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,466,951	15,462,601.460	
オーストラリア・ドル 小計			147,672,743.740 (14,294,721,594)	
カナダ・ドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	651,951	8,905,650.660	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	225,612	10,716,570.000	
カナダ・ドル 小計			19,622,220.660 (2,120,965,831)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	7,479,800	15,034,398.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	7,425,500	12,400,585.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	4,274,800	9,746,544.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,843,177	17,871,323.130	
シンガポール・ドル 小計			55,052,850.130 (5,985,345,866)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	3,869,435	8,706,228.750	
ニュージーランド・ドル 小計			8,706,228.750 (785,301,833)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	166,042	3,765,832.560	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	171,171	11,242,511.280	
	KLEPIERRE	354,594	8,779,747.440	
	MERCIALYS	180,896	1,795,392.800	
	AEDIFICA	71,296	4,374,009.600	
	COFINIMMO	95,153	6,627,406.450	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	265,823	7,225,069.140	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	121,820	3,557,144.000	
	MONTEA NV	38,498	3,237,681.800	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	652,770	6,233,953.500	

ユーロ 小計			56,838,748.570 (8,991,890,024)	
香港・ドル	LINK REIT	3,279,392	140,194,008.000	
香港・ドル 小計			140,194,008.000 (2,594,991,088)	
投資証券 合計			92,628,742,072 [92,628,742,072]	
合計			92,628,742,072 [92,628,742,072]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 30銘柄	100%	52.2%
イギリス・ポンド	投資証券 10銘柄	100%	10.3%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	100%	15.4%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	2.3%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	6.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.8%
ユーロ	投資証券 10銘柄	100%	9.7%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	2.8%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ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

	2023年1月10日現在 金額（円）	2024年1月10日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	853,766,767	1,679,355,842
株式	15,667,612,640	32,096,346,070
派生商品評価勘定	-	19,030,650
未収入金	33,211,300	319,723,314
未収配当金	21,482,225	35,937,300
差入委託証拠金	-	19,136,949
流動資産合計	16,576,072,932	34,169,530,125
資産合計	16,576,072,932	34,169,530,125
負債の部		
流動負債		
前受金	-	13,175,000
未払金	69,064,952	206,422,066
未払解約金	11,207,000	2,000,000
流動負債合計	80,271,952	221,597,066
負債合計	80,271,952	221,597,066
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,640,307,388	6,963,731,899
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,855,493,592	26,984,201,160
元本等合計	16,495,800,980	33,947,933,059
純資産合計	16,495,800,980	33,947,933,059
負債純資産合計	16,576,072,932	34,169,530,125

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	4,588,117,450円	4,640,307,388円
期中追加設定元本額	494,623,440円	2,944,821,209円
期中一部解約元本額	442,433,502円	621,396,698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）	2,717,853,184円	5,255,344,659円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	21,660,400円	-円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,298,272円	19,219,308円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,506,058円	12,659,665円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	280,462,556円	236,257,934円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	44,893,736円	-円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	46,259,114円	36,025,973円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	221,786,367円	202,460,521円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	436,012,950円	401,671,490円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	835,574,751円	800,092,349円
計	4,640,307,388円	6,963,731,899円
2. 期末日における受益権の総数	4,640,307,388口	6,963,731,899口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	25,464,405	1,869,511,932
合計	25,464,405	1,869,511,932

(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	2023年1月10日現在				2024年1月10日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	-	-	-	-	396,950,000	-	415,990,000	19,040,000
合計	-	-	-	-	396,950,000	-	415,990,000	19,040,000

## （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）

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	3,5549円	4,8750円
（1万口当たり純資産額）	（35,549円）	（48,750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	
ニッスイ	203,600	794.20	161,699,120	
I N P E X	45,700	1,951.00	89,160,700	
鹿島建設	175,000	2,512.50	439,687,500	
大東建託	43,000	16,285.00	700,255,000	
五洋建設	130,500	840.00	109,620,000	
住友林業	75,400	4,318.00	325,577,200	
九電工	6,600	5,219.00	34,445,400	
大 気 社	23,500	4,235.00	99,522,500	
コカ・コーラボトラーズJHD	61,700	2,029.50	125,220,150	
日清オイリオグループ	53,200	4,480.00	238,336,000	
アダストリア	28,100	3,345.00	93,994,500	
エレマテック	32,200	1,810.00	58,282,000	
パルグループHLDGS	95,600	2,311.00	220,931,600	
ゲ ン ゼ	65,400	5,110.00	334,194,000	
ダイワボウHD	247,000	3,114.00	769,158,000	
レスターホールディングス	16,500	2,868.00	47,322,000	
三洋貿易	76,800	1,238.00	95,078,400	
東急不動産HD	387,400	974.00	377,327,600	
S U M C O	152,700	2,108.50	321,967,950	

AND DOホールディングス	58,200	1,070.00	62,274,000	
共和レザー	74,700	776.00	57,967,200	
セーレン	34,700	2,487.00	86,298,900	
レンゴー	94,900	962.40	91,331,760	
日本曹達	39,900	5,690.00	227,031,000	
トクヤマ	81,500	2,477.50	201,916,250	
東亜合成	47,600	1,354.00	64,450,400	
三井化学	75,600	4,316.00	326,289,600	
リケンテクノス	72,900	854.00	62,256,600	
花王	46,200	5,962.00	275,444,400	
アステラス製薬	294,500	1,763.00	519,203,500	
日本空調サービス	86,300	830.00	71,629,000	
サワイグループHD	31,800	5,488.00	174,518,400	
富士フイルムHLDGS	62,900	8,823.00	554,966,700	
コスモエネルギーHLDGS	19,600	6,074.00	119,050,400	
TOYO TIRE	139,400	2,412.50	336,302,500	
日本製鉄	138,400	3,338.00	461,979,200	
中部鋼鈹	22,800	2,445.00	55,746,000	
大同特殊鋼	227,000	1,503.50	341,294,500	
大紀アルミニウム	96,700	1,219.00	117,877,300	
U A C J	47,500	3,780.00	179,550,000	
住友電工	429,500	1,873.50	804,668,250	
フジクラ	340,500	1,116.00	379,998,000	
S W C C	32,900	2,889.00	95,048,100	
日東精工	93,200	549.00	51,166,800	
マルゼン	35,400	2,728.00	96,571,200	
日本発条	145,900	1,208.50	176,320,150	
芝浦機械	96,300	3,555.00	342,346,500	
ベルシステム24HLDGS	191,000	1,755.00	335,205,000	
小松製作所	209,600	3,850.00	806,960,000	
S A N K Y O	79,600	8,667.00	689,893,200	
日立	106,600	10,600.00	1,129,960,000	
富士電機	21,900	6,204.00	135,867,600	
ダイヘン	69,500	6,480.00	450,360,000	
堀場製作所	16,000	11,135.00	178,160,000	
芝浦電子	10,300	5,600.00	57,680,000	
三菱重工業	83,800	8,831.00	740,037,800	
いすゞ自動車	287,000	1,938.00	556,206,000	
トヨタ自動車	623,800	2,745.00	1,712,331,000	
プレス工業	168,000	598.00	100,464,000	

本田技研	423,400	1,533.50	649,283,900	
萩原電気HLDGS	26,800	4,840.00	129,712,000	
ダイトロン	53,200	2,824.00	150,236,800	
大日本印刷	87,800	4,213.00	369,901,400	
信越ポリマー	89,700	1,637.00	146,838,900	
豊田通商	38,700	9,043.00	349,964,100	
東京エレクトロン	23,900	25,385.00	606,701,500	
B I P R O G Y	93,400	4,445.00	415,163,000	
三菱商事	487,500	2,326.50	1,134,168,750	
阪和興業	27,700	5,130.00	142,101,000	
丸井グループ	194,200	2,504.00	486,276,800	
三菱UFJフィナンシャルG	1,103,900	1,260.00	1,390,914,000	
三井住友トラストHD	185,400	2,838.00	526,165,200	
三井住友フィナンシャルG	131,200	7,124.00	934,668,800	
ふくおかフィナンシャルG	44,400	3,403.00	151,093,200	
山陰合同銀行	165,500	1,010.00	167,155,000	
SBIホールディングス	10,400	3,385.00	35,204,000	
オリックス	84,200	2,760.50	232,434,100	
東京海上HD	399,800	3,592.00	1,436,081,600	
T&Dホールディングス	41,800	2,319.50	96,955,100	
東京建物	21,700	2,221.00	48,195,700	
鴻池運輸	2,000	1,946.00	3,892,000	
センコーグループHLDGS	145,500	1,155.00	168,052,500	
セイノーホールディングス	76,800	2,194.00	168,499,200	
日本郵船	160,800	4,637.00	745,629,600	
九州旅客鉄道	103,800	3,222.00	334,443,600	
渋沢倉庫	23,700	3,075.00	72,877,500	
上組	196,600	3,466.00	681,415,600	
日本電信電話	6,530,100	176.90	1,155,174,690	
K D D I	94,700	4,655.00	440,828,500	
光通信	13,400	24,870.00	333,258,000	
大阪瓦斯	166,400	3,153.00	524,659,200	
合計			32,096,346,070	

## (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

	2023年1月10日現在 金額（円）	2024年1月10日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	283,932,737	230,910,216
コール・ローン	48,444,778	49,077,590
株式	3,280,942,811	4,344,797,348
優先出資証券	1,013,821,558	1,061,258,526
投資証券	30,629,157	63,888,674
未収入金	32,264,033	6,872,970
未収配当金	4,395,222	5,282,009
未収利息	3,952,092	3,457,946
流動資産合計	4,698,382,388	5,765,545,279
資産合計	4,698,382,388	5,765,545,279
負債の部		
流動負債		
未払金	106,915,986	1,650,143
流動負債合計	106,915,986	1,650,143
負債合計	106,915,986	1,650,143
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,041,508,142	1,015,888,611
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,549,958,260	4,748,006,525
元本等合計	4,591,466,402	5,763,895,136
純資産合計	4,591,466,402	5,763,895,136
負債純資産合計	4,698,382,388	5,765,545,279

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)優先出資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>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。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	941,474,515円	1,041,508,142円
期中追加設定元本額	143,771,419円	56,334,834円
期中一部解約元本額	43,737,792円	81,954,365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）	5,327,449円	5,315,620円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,361,590円	3,548,077円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	73,878,680円	66,243,698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	-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	10,087,335円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	138,629,610円	134,061,273円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	272,054,012円	266,144,491円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	523,508,691円	530,488,117円
計	1,041,508,142円	1,015,888,611円
2. 期末日における受益権の総数	1,041,508,142口	1,015,888,611口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	283,484,640	373,139,908
優先出資証券	50,486,504	80,510,146
投資証券	657,496	5,059,872
合計	334,628,640	458,709,926

(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

2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	4,4085円	5,6737円
(1万口当たり純資産額)	(44,085円)	(56,737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	112.730	229,969.200	
	ADOBE INC	843	586.200	494,166.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,339	78.380	183,330.820	
	CITIGROUP INC	6,713	53.480	359,011.240	
	DANAHER CORP	1,116	230.870	257,650.920	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,525	127.040	447,816.000	
	APPLE INC	11,730	185.140	2,171,692.200	
	BECTON DICKINSON AND CO	1,084	237.840	257,818.560	
	NISOURCE INC	5,885	27.140	159,718.900	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	6,501	52.950	344,227.950	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,535	39.040	411,286.400	
	JPMORGAN CHASE & CO	3,077	170.660	525,120.820	
	SERVICENOW INC	462	698.670	322,785.540	
	MORGAN STANLEY	3,553	92.060	327,089.180	
	BROADCOM INC	1,023	1,082.490	1,107,387.270	
	DEERE & CO	834	393.220	327,945.480	
	CONSOLIDATED EDISON INC	2,119	93.700	198,550.300	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	2,760	80.820	223,063.200	
	COSTCO WHOLESALE CORP	576	667.180	384,295.680	
	CUMMINS INC	1,060	239.410	253,774.600	
CSX CORP	10,864	34.610	376,003.040		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,117	228.190	254,888.230		
AMAZON.COM INC	7,273	151.370	1,100,914.010		

EXXON MOBIL CORP	1,772	99.670	176,615.240	
FORD MOTOR CO	10,276	11.840	121,667.840	
NEXTERA ENERGY INC	1,291	62.010	80,054.910	
FREEMPORT-MCMORAN INC	4,483	41.700	186,941.100	
GENERAL MOTORS CO	6,491	36.540	237,181.140	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,164	383.740	446,673.360	
ALPHABET INC-CL A	7,055	140.950	994,402.250	
HOME DEPOT INC	1,248	346.190	432,045.120	
HUMANA INC	339	459.300	155,702.700	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	15,278	16.140	246,586.920	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,033	160.080	325,442.640	
JOHNSON & JOHNSON	2,347	161.630	379,345.610	
ELI LILLY & CO	477	625.480	298,353.960	
MCDONALD'S CORP	1,872	290.870	544,508.640	
META PLATFORMS INC CLASS A	2,037	357.430	728,084.910	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,792	67.630	188,822.960	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	894	312.010	278,936.940	
BAKER HUGHES CO	2,939	31.620	92,931.180	
ROCKWELL AUTOMATION INC	468	302.970	141,789.960	
MERCK & CO. INC.	2,728	118.430	323,077.040	
NIKE INC -CL B	3,010	102.740	309,247.400	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,924	95.590	279,505.160	
PFIZER INC	2,215	29.400	65,121.000	
DOW INC	3,301	53.940	178,055.940	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,601	149.300	239,029.300	
PEPSICO INC	1,631	167.170	272,654.270	
CHEVRON CORP	2,694	145.700	392,515.800	
TESLA INC	1,608	234.960	377,815.680	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,462	97.540	337,683.480	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,949	159.940	311,723.060	
UNITEDHEALTH GROUP INC	482	538.370	259,494.340	
ELEVANCE HEALTH INC	399	483.240	192,812.760	
WALT DISNEY CO/THE	2,728	89.670	244,619.760	
WASTE MANAGEMENT INC	1,868	178.230	332,933.640	
WALMART INC	1,403	159.310	223,511.930	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,023	239.870	245,387.010	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,552	263.330	408,688.160	
PPL CORP	5,001	27.820	139,127.820	
NVIDIA CORP	1,553	531.400	825,264.200	

	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	563	541.850	305,061.550	
	MASTERCARD INC - A	924	422.600	390,482.400	
	ONEOK INC	1,640	70.390	115,439.600	
	BANK OF AMERICA CORP	15,204	33.630	511,310.520	
	ADVANCED MICRO DEVICES	2,553	149.260	381,060.780	
	KENVUE INC	14,472	21.850	316,213.200	
	EATON CORP PLC	2,071	239.480	495,963.080	
	APPLIED MATERIALS INC	1,698	151.030	256,448.940	
	GILEAD SCIENCES INC	3,517	86.060	302,673.020	
	CHORD ENERGY CORP	1,102	157.430	173,487.860	
	CARDINAL HEALTH INC	2,164	103.370	223,692.680	
	MICROSOFT CORP	5,465	375.790	2,053,692.350	
	MEDTRONIC PLC	3,103	86.660	268,905.980	
	CENTERPOINT ENERGY INC	5,807	29.230	169,738.610	
	CHUBB LTD	992	225.310	223,507.520	
	PAYPAL HOLDINGS INC	1,893	61.050	115,567.650	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	6,676	18.680	124,707.680	
	COMCAST CORP-CLASS A	6,693	43.280	289,673.040	
アメリカ・ドル 小計				29,450,487.730 (4,261,191,070)	
カナダ・ドル	SUNCOR ENERGY INC	7,747	43.810	339,396.070	
	TC ENERGY CORP	3,547	53.010	188,026.470	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,561	69.100	246,065.100	
カナダ・ドル 小計				773,487.640 (83,606,278)	
合計				4,344,797,348 [4,344,797,348]	

## (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	SCE TRUST IV FR	2,828	62,951.280	
		SCE TRUST V 5.45 K	4,103	99,743.930	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	6,644	162,113.600	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2,720	58,044.800	
		AT&T INC 5.35	3,943	94,908.010	
		BANK OF AMERICA CORP 6 GG	1,547	38,953.460	
		METLIFE INC 5.625 E	2,277	55,854.810	

RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75 F	4,265	102,061.450	
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	3,819	94,978.530	
US BANCORP 5.5 K	7,158	167,210.880	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	9,438	234,723.060	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	1,545	39,243.000	
CMS ENERGY CORP 5.875	12,484	309,977.720	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	2,220	55,788.600	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	985	21,040.970	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	2,275	56,033.250	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100	26,455.000	
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	10,786	250,127.340	
ALLSTATE CORP 5.1 H	6,377	143,673.810	
ENSTAR GROUP LTD FR	3,906	98,118.720	
SEMPRA 5.75	6,407	158,573.250	
MORGAN STANLEY 4.875 L	2,561	56,982.250	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.125	4,604	102,185.780	
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.1	4,569	106,777.530	
METLIFE INC 4.75 F	4,771	99,570.770	
SOUTHERN CO 4.95 2020	9,007	206,845.750	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	11,675	233,733.500	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	8,166	202,598.460	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	6,948	144,032.040	
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1,403	27,751.340	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 4.5	5,300	101,442.000	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167	55,454.170	
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	13,966	280,157.960	

BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN	12,469	244,891.160	
EQUITABLE HOLDINGS INC 4.3 C	8,593	142,643.800	
BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	7,370	136,934.600	
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	8,391	156,072.600	
US BANCORP 4 M	7,954	141,422.120	
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12,443	257,818.960	
CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	2,458	49,651.600	
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	12,263	257,768.260	
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2	8,177	157,897.870	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD 4.2	961	16,596.470	
BANK OF AMERICA CORP 4.75	5,718	120,078.570	
US BANCORP 4.5	4,012	79,798.680	
WESCO INTERNATIONAL INC FR	699	18,481.560	
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	689	17,872.660	
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	342	6,898.140	
RGA FR	2,712	70,864.560	
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4,900	134,652.000	
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I	3,250	84,760.000	
WR BERKLEY CORPORATION 4.125	3,226	63,939.320	
ALLSTATE CORP 7.375	3,154	84,621.820	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625	6,428	175,548.680	
SCE TRUST 7 7.5	11,053	287,820.120	
F&G ANNUITIES & LIFE INC 7.95	3,815	99,647.800	
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	1,499	37,924.700	
MORGAN STANLEY 6.875 F	4,500	112,680.000	

		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	1,495	38,025.320	
		ALLSTATE CORP FR	1,482	37,479.630	
		MOMORGAN STANLEY FR	2,327	58,314.620	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	8,993	222,756.610	
		CITIGROUP INC FR J	2,828	72,736.160	
	アメリカ・ドル	小計		7,334,705.410 (1,061,258,526)	
優先出資証券 合計				1,061,258,526 [1,061,258,526]	
投資証券	アメリカ・ドル	DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7,569	176,509.080	
		PUBLIC STORAGE 4.625 L	5,992	128,468.480	
		PUBLIC STORAGE 3.9 0	7,800	136,578.000	
	アメリカ・ドル	小計		441,555.560 (63,888,674)	
投資証券 合計				63,888,674 [63,888,674]	
合計				1,125,147,200 [1,125,147,200]	

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 80銘柄	79.1%	19.7%	1.2%	98.5%
	優先出資証券 63銘柄				
	投資証券 3銘柄				
カナダ・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	-%	1.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2023年1月10日現在 金額 (円)	2024年1月10日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	59,663,990	64,459,961
コール・ローン	14,658,568	5,729,126
株式	1,482,417,795	1,671,365,008
未収配当金	2,087,458	2,326,987
流動資産合計	1,558,827,811	1,743,881,082
資産合計	1,558,827,811	1,743,881,082
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 683,447,022	614,800,738
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	875,380,789	1,129,080,344
元本等合計	1,558,827,811	1,743,881,082
純資産合計	1,558,827,811	1,743,881,082
負債純資産合計	1,558,827,811	1,743,881,082

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1期首	2022年1月12日	2023年1月11日

期首元本額	671,590,671円	683,447,022円
期中追加設定元本額	89,094,907円	50,292,516円
期中一部解約元本額	77,238,556円	118,938,800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）	10,569,177円	10,525,826円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,655,042円	7,040,064円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	151,100,386円	132,343,442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	-円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	24,865,274円	20,094,577円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	68,720,962円	63,848,184円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	134,800,822円	127,478,989円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	259,462,979円	253,469,656円
計	683,447,022円	614,800,738円
2. 期末日における受益権の総数	683,447,022口	614,800,738口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	184,293,240	66,502,700
合計	184,293,240	66,502,700

(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

2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	2,2808円	2,8365円
(1万口当たり純資産額)	(22,808円)	(28,365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	12,054	24.810	299,059.740	
	UNILEVER PLC	4,602	38.600	177,637.200	
	PRUDENTIAL PLC	15,213	8.458	128,671.550	
	AVIVA PLC	31,677	4.336	137,351.470	
	GSK	13,036	15.762	205,473.430	
	M&G PLC	70,474	2.263	159,482.660	
	TESCO PLC	90,643	3.005	272,382.210	
	VODAFONE GROUP PLC	104,183	0.700	72,938.510	
	NATIONAL GRID PLC	18,318	10.740	196,735.320	
	HSBC HOLDINGS PLC	44,484	6.345	282,250.980	
イギリス・ポンド 小計				1,931,983.070 (355,407,605)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	899	29.400	26,430.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,346	252.250	339,528.500	
	NESTLE SA-REG	5,718	98.820	565,052.760	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	742	439.000	325,738.000	
	NOVARTIS AG-REG	4,498	91.140	409,947.720	
	GIVAUDAN-REG	79	3,383.000	267,257.000	
スイス・フラン 小計				1,933,954.580 (328,308,129)	
スウェーデン・クローナ	ELECTROLUX AB-SER B	2,548	104.950	267,412.600	
スウェーデン・クローナ 小計				267,412.600 (3,775,865)	

デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	1,232	723.100	890,859.200	
デンマーク・クローネ 小計				890,859.200 (18,895,124)	
ユーロ	SIEMENS AG-REG	2,870	159.400	457,478.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,071	100.820	309,618.220	
	BASF SE	3,768	45.510	171,481.680	
	ALLIANZ SE-REG	1,174	243.550	285,927.700	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	695	376.800	261,876.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	19,003	22.510	427,757.530	
	DHL GROUP	6,108	44.745	273,302.460	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,669	26.975	179,896.270	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,845	114.050	210,422.250	
	KONINKLIJKE KPN NV	90,114	3.121	281,245.790	
	TOTALENERGIES SE	5,570	60.120	334,868.400	
	MICHELIN (CGDE)	8,835	31.640	279,539.400	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,784	173.920	484,193.280	
	BNP PARIBAS	4,089	62.630	256,094.070	
	CAPGEMINI SE	1,793	184.500	330,808.500	
	AXA SA	9,470	29.635	280,643.450	
	SANOFI	3,990	95.190	379,808.100	
	INTESA SANPAOLO	82,889	2.757	228,524.970	
ENI SPA	13,257	14.924	197,847.460		
ENEL SPA	49,350	6.699	330,595.650		
ENAGAS SA	8,758	15.735	137,807.130		
ユーロ 小計				6,099,736.310 (964,978,285)	
合計				1,671,365,008 [1,671,365,008]	

## (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%	21.3%
スイス・フラン	株式 6銘柄	100%	19.6%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.1%
ユーロ	株式 21銘柄	100%	57.8%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・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

	2023年1月10日現在 金額 (円)	2024年1月10日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	22,909,593	9,990,041
コール・ローン	4,562,506	4,792,407
株式	670,513,894	672,677,218
未収配当金	262,670	616,213
流動資産合計	698,248,663	688,075,879
資産合計	698,248,663	688,075,879
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,459,000
流動負債合計	-	1,459,000
負債合計	-	1,459,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 236,240,519	195,040,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	462,008,144	491,576,179

元本等合計	698,248,663	686,616,879
純資産合計	698,248,663	686,616,879
負債純資産合計	698,248,663	688,075,879

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	233,981,686円	236,240,519円
期中追加設定元本額	29,453,129円	21,910,121円
期中一部解約元本額	27,194,296円	63,109,940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	8,249,410円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,488,884円	5,558,545円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	115,797,057円	104,042,023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	-円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	18,966,039円	16,180,108円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	10,032,864円	8,674,072円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	19,730,643円	17,495,402円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	37,914,155円	34,841,140円
計	236,240,519円	195,040,700円
2. 期末日における受益権の総数	236,240,519口	195,040,700口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	62,583,652	29,261,477
合計	62,583,652	29,261,477

（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

2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9557円 (29,557円)	3.5204円 (35,204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	6,550	25.890	169,579.500	
	BHP GROUP LTD	8,690	48.970	425,549.300	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,778	31.100	117,495.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,300	30.900	194,670.000	
	WESTPAC BANKING CORP	7,000	23.100	161,700.000	
	RIO TINTO LTD	1,220	131.900	160,918.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	9,000	8.420	75,780.000	
	SEEK LTD	2,800	26.050	72,940.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,690	113.020	304,023.800	
	MACQUARIE GROUP LTD	920	179.510	165,149.200	
	CSL LTD	800	290.100	232,080.000	
WESFARMERS LTD	3,680	56.870	209,281.600		
オーストラリア・ドル 小計				2,289,167.200 (221,591,385)	
シンガポール・ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,000	32.870	164,350.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	11,100	12.880	142,968.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	59,800	2.390	142,922.000	

シンガポール・ドル 小計				450,240.000 (48,950,092)	
韓国・ウォン	KIA CORP	1,040	89,100.000	92,664,000.000	
	SK HYNIX INC	1,200	137,400.000	164,880,000.000	
	LG CORP	900	79,500.000	71,550,000.000	
	POSCO	140	460,500.000	64,470,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	640	168,200.000	107,648,000.000	
	KT&G CORP	1,300	90,600.000	117,780,000.000	
	NAVER CORP	250	229,500.000	57,375,000.000	
	LG CHEM LTD	165	471,500.000	77,797,500.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,630	74,700.000	569,961,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	290	131,600.000	38,164,000.000	
韓国・ウォン 小計				1,362,289,500.000 (149,306,929)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	8,000	44.600	356,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,500	79.300	356,850.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,900	245.200	711,080.000	
	AIA GROUP LTD	19,600	63.600	1,246,560.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	2,500	86.050	215,125.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	27,000	20.100	542,700.000	
香港・ドル 小計				3,429,115.000 (63,472,919)	
台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	71,000	41.000	2,911,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	18,000	126.500	2,277,000.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	27,000	60.800	1,641,600.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	7,000	295.500	2,068,500.000	
	ACCTON TECHNOLOGY CORP	1,000	516.000	516,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	7,000	216.000	1,512,000.000	
	MEDIATEK INC	4,000	928.000	3,712,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	9,000	151.500	1,363,500.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	500.000	2,000,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	6,000	162.500	975,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	22,000	586.000	12,892,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	34,000	101.000	3,434,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	6,000	455.000	2,730,000.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	52,000	50.100	2,605,200.000		
台湾・ドル 小計				40,637,800.000 (189,355,893)	
合計				672,677,218 [672,677,218]	

## (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 12銘柄	100%	33.0%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	7.3%
韓国・ウォン	株式 10銘柄	100%	22.2%
香港・ドル	株式 6銘柄	100%	9.4%
台湾・ドル	株式 14銘柄	100%	28.1%

## 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」- 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

	2023年1月10日現在 金額(円)	2024年1月10日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,766,010,842	3,007,732,045
投資証券	2 137,648,483,600	166,342,836,784
派生商品評価勘定	-	12,788,780
未収入金	657,999,915	260,185,514
未収配当金	1,036,728,049	1,414,179,099
前払金	105,212,400	-
流動資産合計	142,214,434,806	171,037,722,222

資産合計		142,214,434,806	171,037,722,222
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		87,155,400	326,410
前受金		-	19,811,050
未払金		471,736,274	587,318,497
未払解約金		12,697,000	2,660,000
流動負債合計		571,588,674	610,115,957
負債合計		571,588,674	610,115,957
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,460,993,574	49,244,470,777
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		99,181,852,558	121,183,135,488
元本等合計		141,642,846,132	170,427,606,265
純資産合計		141,642,846,132	170,427,606,265
負債純資産合計		142,214,434,806	171,037,722,222

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	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。
	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	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首	2022年1月12日	2023年1月11日
期首元本額	36,668,053,622円	42,460,993,574円
期中追加設定元本額	6,531,084,834円	9,931,753,038円
期中一部解約元本額	738,144,882円	3,148,275,835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）	39,552,450,503円	46,021,583,486円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,974,369円	13,200,614円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,333,819円	8,632,593円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	41,696,345円	46,698,580円
6資産バランスファンド（分配型）	73,760,418円	74,993,956円
6資産バランスファンド（成長型）	212,258,656円	227,494,959円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	21,134,370円	20,266,803円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	24,178,392円	24,225,499円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	349,951,698円	418,558,342円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	457,604,313円	551,298,263円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	702,833,671円	878,935,412円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	250,736,107円	226,859,539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）	53,562,973円	54,469,768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	17,468,024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）	90,988,033円	90,988,033円
	ダイワ・アクティブリート・ファンド（年4回決算型）	592,925,046円	568,796,906円
計		42,460,993,574円	49,244,470,777円
2.	期末日における受益権の総数	42,460,993,574口	49,244,470,777口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っておりません。 投資証券 982,100,000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せん。 投資証券 1,193,000,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、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。
----------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	6,969,619,134	473,493,490
合計	6,969,619,134	473,493,490

(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	2023年1月10日現在				2024年1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	2,480,312,400	-	2,393,300,000	87,012,400	3,199,482,950	-	3,212,142,000	12,659,050
合計	2,480,312,400	-	2,393,300,000	87,012,400	3,199,482,950	-	3,212,142,000	12,659,050

## (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)

	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	3.3358円	3.4608円
(1万口当たり純資産額)	(33,358円)	(34,608円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	サンケイリアルエステート	6,651	603,245,700	
	SOSILA物流リート投	6,405	776,926,500	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	10,475	6,337,375,000	
	森ヒルズリート	18,330	2,579,031,000	
	産業ファンド	26,756	3,794,000,800	
	アドバンス・レジデンス	15,524	5,006,490,000	
	A P I 投資法人	5,683	2,207,845,500	
	G L P 投資法人	70,744	10,031,499,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	9,466	2,967,591,000	

日本プロロジスリート	41,151	11,287,719,300	
星野リゾート・リート	2,080	1,189,760,000	
Oneリート投資法人	4,206	1,132,675,800	
イオンリート投資	28,349	4,000,043,900	
ヒューリックリート投資法	24,849	3,719,895,300	
日本リート投資法人	8,725	2,966,500,000	
積水ハウス・リート投資	25,302	1,960,905,000	
トーセイ・リート投資法人	1,070	146,055,000	
ヘルスケア&メディカル投資	4,266	597,240,000	
野村不動産マスターF	37,330	6,069,858,000	
いちごホテルリート投資	1,867	210,597,600	
ラサールロジポート投資	23,570	3,592,068,000	
三井不ロジパーク	4,428	2,043,522,000	
投資法人みらい	10,260	452,979,000	
三菱地所物流REIT	13,984	5,271,968,000	
CREロジスティクスファンド	11,213	1,751,470,600	
ザイマックス・リート	5,774	685,373,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,908	372,514,800	
日本ビルファンド	18,258	11,137,380,000	
ジャパンリアルエステイト	11,913	6,945,279,000	
日本都市ファンド投資法人	78,986	8,064,470,600	
オリックス不動産投資	37,736	6,335,874,400	
日本プライムリアルティ	14,406	5,178,957,000	
NTT都市開発リート投資法人	14,954	1,860,277,600	
東急リアル・エステート	4,938	848,842,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,508	278,638,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	34,854	5,140,965,000	
森トラストリート投資法人	1,160	85,608,000	
インヴィンシブル投資法人	53,150	3,141,165,000	
フロンティア不動産投資	5,205	2,258,970,000	
平和不動産リート	5,953	800,678,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,588	1,021,144,800	
KDX不動産投資法人	53,161.520	8,596,217,784	
いちごオフィスリート投資法人	20,369	1,690,627,000	
大和証券オフィス投資法人	3,180	2,130,600,000	
阪急阪神リート投資法人	6,365	886,644,500	
スターツプロシード投資法人	635	127,698,500	
大和ハウスリート投資法人	35,363	9,095,363,600	

	ジャパン・ホテル・リート投資法人	93,693	6,577,248,600	
	大和証券リビング投資法人	22,911	2,385,035,100	
投資証券 合計			166,342,836,784	
合計			166,342,836,784	

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 1,000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。

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2023年1月11日から2024年1月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 2023年1月10日現在	第18期 2024年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	140,338,341	168,567,562
親投資信託受益証券	9,317,155,790	11,609,372,869
未収入金	7,828,000	2,772,000
流動資産合計	9,465,322,131	11,780,712,431
資産合計	9,465,322,131	11,780,712,431
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,212,138	4,840,651
未払受託者報酬	2,614,558	3,078,013
未払委託者報酬	52,292,037	61,561,126
その他未払費用	392,101	461,610
流動負債合計	66,510,834	69,941,400
負債合計	66,510,834	69,941,400
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,475,748,849	1 4,848,519,962
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,923,062,448	6,862,251,069
（分配準備積立金）	1,730,775,163	2,592,457,869
元本等合計	9,398,811,297	11,710,771,031
純資産合計	9,398,811,297	11,710,771,031
負債純資産合計	9,465,322,131	11,780,712,431

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期		第18期	
	自	2022年1月12日 至 2023年1月10日	自	2023年1月11日 至 2024年1月10日
営業収益				
受取利息		13		40
有価証券売買等損益		309,372,138		1,594,068,079
その他収益		-		431
営業収益合計		309,372,125		1,594,068,550
営業費用				
支払利息		36,142		41,369
受託者報酬		5,009,162		5,804,974
委託者報酬	1	100,185,197	1	116,101,282
その他費用		751,204		870,572
営業費用合計		105,981,705		122,818,197
営業利益又は営業損失（ ）		415,353,830		1,471,250,353
経常利益又は経常損失（ ）		415,353,830		1,471,250,353
当期純利益又は当期純損失（ ）		415,353,830		1,471,250,353
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（ ）		9,132,218		74,424,103
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,685,955,747		4,923,062,448
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,082,697,821		1,072,859,128
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,082,697,821		1,072,859,128
剰余金減少額又は欠損金増加額		439,369,508		530,496,757
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		439,369,508		530,496,757
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,923,062,448		6,862,251,069

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第18期
	自2023年1月11日 至2024年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首元本額	3,918,064,052円	4,475,748,849円
期中追加設定元本額	926,048,289円	850,834,868円
期中一部解約元本額	368,363,492円	478,063,755円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	4,475,748,849口	4,848,519,962口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第17期	第18期
	自2022年1月12日 至2023年1月10日	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	14,771,639円	17,279,620円

2. 2 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,944,856,254円)及び分配準備積立金(1,730,775,163円)より分配対象額は5,675,631,417円(1万口当たり12,680.85円)であり、分配を行っております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,030,169,221円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,586,045,975円)及び分配準備積立金(1,562,288,648円)より分配対象額は7,178,503,844円(1万口当たり14,805.56円)であり、分配を行っておりません。</p>
---------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第18期 自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期
	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	311,751,348	1,532,535,404
合計	311,751,348	1,532,535,404

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第17期	第18期
2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第18期
自2023年1月11日
至2024年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	2.0999円	2.4153円
(1万口当たり純資産額)	(20,999円)	(24,153円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	552,403,507	1,901,704,313	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,541,689,326	1,899,823,756	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	497,326,936	2,008,554,296	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	401,671,490	1,958,148,513	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	266,144,491	1,510,023,998	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	127,478,989	361,594,152	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	17,495,402	61,590,813	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	551,298,263	1,907,933,028	
親投資信託受益証券 合計			11,609,372,869	
合計			11,609,372,869	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ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」-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、当ファンドの計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

#### 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

#### 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2023年1月11日から2024年1月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 2023年1月10日現在	第18期 2024年1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	187,220,313	237,094,552
親投資信託受益証券	11,933,829,476	15,518,402,925
未収入金	11,081,000	4,666,000
流動資産合計	12,132,130,789	15,760,163,477
資産合計		
	12,132,130,789	15,760,163,477
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,837,692	7,647,309
未払受託者報酬	3,322,675	4,086,899
未払委託者報酬	76,422,365	93,999,764
その他未払費用	498,329	612,949
流動負債合計	94,081,061	106,346,921
負債合計		
	94,081,061	106,346,921
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 5,076,067,557	1 5,535,598,650
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,961,982,171	10,118,217,906
（分配準備積立金）	2,454,582,841	4,091,305,129
元本等合計	12,038,049,728	15,653,816,556
純資産合計		
	12,038,049,728	15,653,816,556
負債純資産合計		
	12,132,130,789	15,760,163,477

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期		第18期	
	自	2022年1月12日 至 2023年1月10日	自	2023年1月11日 至 2024年1月10日
営業収益				
受取利息		17		56
有価証券売買等損益		343,601,671		2,610,962,449
その他収益		-		8,612
営業収益合計		343,601,654		2,610,971,117
営業費用				
支払利息		47,263		55,916
受託者報酬		6,273,233		7,611,847
委託者報酬	1	144,286,151	1	175,074,560
その他費用		940,830		1,141,613
営業費用合計		151,547,477		183,883,936
営業利益又は営業損失( )		495,149,131		2,427,087,181
経常利益又は経常損失( )		495,149,131		2,427,087,181
当期純利益又は当期純損失( )		495,149,131		2,427,087,181
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( )		16,354,644		120,225,411
期首剰余金又は期首欠損金( )		6,280,527,515		6,961,982,171
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,812,452,390		1,599,140,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,812,452,390		1,599,140,922
剰余金減少額又は欠損金増加額		652,203,247		749,766,957
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		652,203,247		749,766,957
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		6,961,982,171		10,118,217,906

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第18期
	自2023年1月11日 至2024年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1. 1 期首元本額	4,264,260,205円	5,076,067,557円
期中追加設定元本額	1,255,999,989円	1,000,538,169円
期中一部解約元本額	444,192,637円	541,007,076円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	5,076,067,557口	5,535,598,650口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第17期	第18期
	自2022年1月12日 至2023年1月10日	自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	24,880,913円	30,435,229円

2. 2 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,647,906,216円)及び分配準備積立金(2,454,582,841円)より分配対象額は8,102,489,057円(1万口当たり15,962.14円)であり、分配を行っております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,874,463,717円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,619,156,400円)及び分配準備積立金(2,216,841,412円)より分配対象額は10,710,461,529円(1万口当たり19,348.33円)であり、分配を行っておりません。</p>
---------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第18期 自2023年1月11日 至2024年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期
	2024年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	345,163,977	2,521,749,191
合計	345,163,977	2,521,749,191

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第17期	第18期
2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第18期
自2023年1月11日
至2024年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	第17期	第18期
	2023年1月10日現在	2024年1月10日現在
1口当たり純資産額	2,3715円	2,8278円
(1万口当たり純資産額)	(23,715円)	(28,278円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	220,129,859	757,819,052	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	614,822,767	757,646,095	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	794,616,101	3,209,216,047	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	800,092,349	3,900,450,201	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	530,488,117	3,009,830,429	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	253,469,656	718,966,679	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	34,841,140	122,654,749	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	878,935,412	3,041,819,673	
親投資信託受益証券 合計			15,518,402,925	
合計			15,518,402,925	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ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」-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、当ファンドの計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

#### 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

#### 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

#### 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

## 2【ファンドの現況】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

## 【純資産額計算書】

2024年1月31日

資産総額	9,967,733,903円
負債総額	11,427,002円
純資産総額（ - ）	9,956,306,901円
発行済数量	4,630,032,401口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1504円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2024年1月31日

資産総額	291,441,258,888円
負債総額	15,972,207円
純資産総額（ - ）	291,425,286,681円
発行済数量	83,377,847,404口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.4952円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## 純資産額計算書

2024年1月31日

資産総額	54,991,355,441円
負債総額	432,044,219円
純資産総額（ - ）	54,559,311,222円
発行済数量	44,753,317,178口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2191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

2024年1月31日

資産総額	94,995,515,915円
負債総額	1,064,223,705円
純資産総額( - )	93,931,292,210円
発行済数量	23,338,731,654口
1単位当たり純資産額( / )	4.0247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

2024年1月31日

資産総額	172,326,028,980円
負債総額	1,220,247,421円
純資産総額( - )	171,105,781,559円
発行済数量	49,746,605,941口
1単位当たり純資産額( / )	3.4395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

2024年1月31日

資産総額	6,055,445,722円
負債総額	0円
純資産総額( - )	6,055,445,722円
発行済数量	1,012,822,704口
1単位当たり純資産額( / )	5.9788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

2024年1月31日

資産総額	1,788,648,203円
負債総額	1,000,000円
純資産総額( - )	1,787,648,203円

発行済数量	618,531,882口
1単位当たり純資産額( / )	2.8901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

2024年1月31日

資産総額	715,531,050円
負債総額	2,909,446円
純資産総額( - )	712,621,604円
発行済数量	198,756,315口
1単位当たり純資産額( / )	3.5854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

2024年1月31日

資産総額	35,613,756,302円
負債総額	32,535,000円
純資産総額( - )	35,581,221,302円
発行済数量	6,920,370,780口
1単位当たり純資産額( / )	5.1415円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

## 純資産額計算書

2024年1月31日

資産総額	11,986,232,350円
負債総額	11,767,368円
純資産総額( - )	11,974,464,982円
発行済数量	4,883,757,700口
1単位当たり純資産額( / )	2.4519円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

純資産額計算書

2024年1月31日

資産総額	16,118,554,165円
負債総額	19,574,325円
純資産総額( - )	16,098,979,840円
発行済数量	5,568,129,443口
1単位当たり純資産額( / )	2.8913円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2024年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	87	289,382
追加型株式投資信託	790	26,927,149
株式投資信託 合計	877	27,216,530
単位型公社債投資信託	102	168,262
追加型公社債投資信託	14	1,573,863
公社債投資信託 合計	116	1,742,126
総合計	993	28,958,656

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期事業年度（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。

また、第65期事業年度に係る中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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	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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,925	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）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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	14,298	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）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 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ありません。

## (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	当事業年度
(2022年3月31日)	(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。

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

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。

剰余金の配当の総額	10,316百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,955円
基準日	2023年3月31日
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

運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付  利息の受取(注)	19,000  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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付  利息の受取(注)	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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 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	(株)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せん。

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

(注3) 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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)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せん。

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

(注3) 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。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2023年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		2,879
有価証券		110
未収委託者報酬		14,148
関係会社短期貸付金		17,800
その他		629
流動資産合計		35,568
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	184
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		1,009
その他		203
無形固定資産合計		1,213
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		8,477
関係会社株式		3,475
繰延税金資産		628
その他		1,216
投資その他の資産合計		13,797
固定資産合計		15,196
資産合計		50,764

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2023年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	5,255
未払費用	4,567
未払法人税等	2,453
賞与引当金	727
その他	2 725
流動負債合計	13,864
固定負債	
退職給付引当金	2,228
役員退職慰労引当金	58
固定負債合計	2,287
負債合計	16,152
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,594
利益剰余金合計	6,968
株主資本合計	33,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	973
評価・換算差額等合計	973
純資産合計	34,612
負債・純資産合計	50,764

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2023年4月1日
	至 2023年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	36,557

その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	1	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	2	128
営業外費用	3	116
経常利益		8,172
特別利益		-
特別損失	4	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,316	10,316	10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-

当中間期変動額	-	-	-	4,910	4,910	4,910
合計						
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

##### （2）無形固定資産

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

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

#### (3) 役員退職慰労引当金

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

### 4．収益及び費用の計上基準

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

当社は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。

### 5．グループ通算制度の適用

当社は、株式会社大和証券グループ本社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

#### (中間貸借対照表関係)

#### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

#### 2 消費税等の取扱い

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

#### 3 保証債務

当中間会計期間（2023年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,299百万円に対して保証を行っております。

## （中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
投資有価証券売却益	35百万円
有価証券償還益	32百万円
雑収入	32百万円
受取配当金	25百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
有価証券償還損	103百万円

## 4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
ソフトウェア除却損	153百万円
投資有価証券評価損	104百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2023年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	111	7,809	-	7,921
資産合計	111	7,809	-	7,921

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,448百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	111	55	56
（2）その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,297	2,623	325
小計	2,297	2,623	325
合計	7,921	6,518	1,403

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

（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36,557百万円、その他322百万円であります。

（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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間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]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,268.89円
1株当たり中間純利益	2,072.34円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2023年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	(注3)	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	株式会社りそな銀行	279,928百万円	(注6)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,9121-0 (2023年05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	558千米ドル (2023年06月30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。

## 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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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いません。

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

### 第3【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

**独立監査人の監査報告書**

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**

2024年3月1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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2023年1月11日から2024年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2024年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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

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**

2024年3月1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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2023年1月11日から2024年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2024年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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

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**

2024年3月1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DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2023年1月11日から2024年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2024年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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

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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年11月27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	渡部 啓太

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記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。