

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2024年5月30日提出
【計算期間】	6 資産バランスファンド（分配型） 第36特定期間 （自 2023年9月7日 至 2024年3月6日） 6 資産バランスファンド（成長型） 第36計算期間 （自 2023年9月7日 至 2024年3月6日）
【ファンド名】	6 資産バランスファンド（分配型） 6 資産バランスファンド（成長型）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

##### 商品分類表〈各ファンド共通〉

単字型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単字型投信	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〈6資産バランスファンド(分配型)〉

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分表〈6資産バランスファンド(成長型)〉

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

#### < 信託金の限度額 >

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

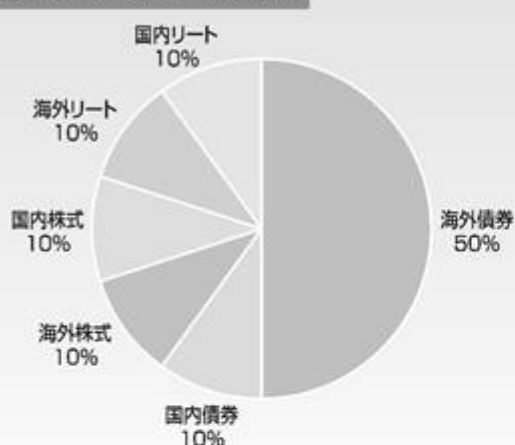
#### < ファンドの特色 >

## 1

内外の債券、株式およびリートに投資します。

- 6資産バランスファンド(分配型)、6資産バランスファンド(成長型)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。

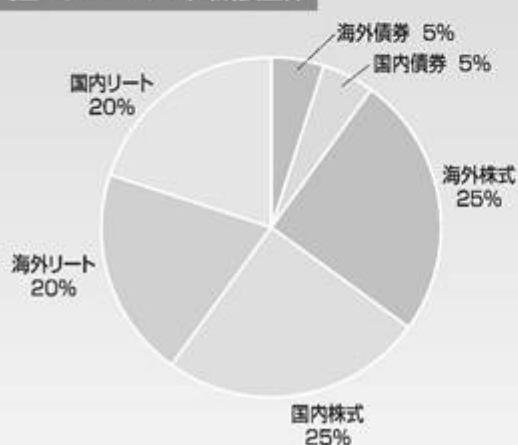
#### < 6資産バランスファンド(分配型) >



	組入比率	海外	国内
債券	60%	50%	10%
株式	20%	10%	10%
リート	20%	10%	10%
合計	100%	70%	30%

※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。

#### < 6資産バランスファンド(成長型) >



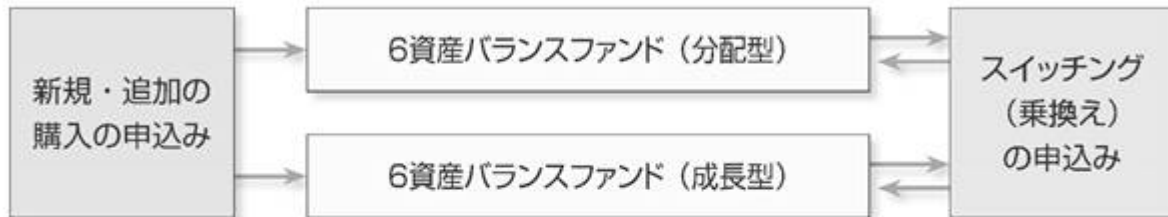
	組入比率	海外	国内
債券	10%	5%	5%
株式	50%	25%	25%
リート	40%	20%	20%
合計	100%	50%	50%

※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。

## 2 「6資産バランスファンド（分配型）」、「6資産バランスファンド（成長型）」の2つのファンドがあります。

- 2つのファンドは、資産配分比率と収益分配の時期・方針が異なります。

◆投資者のみなさまのご判断により、各ファンド間のスイッチング（乗換え）ができます。



### 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。



## 3

## 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

- ドル通貨圏（米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等）、欧州通貨圏（ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等）の2つの通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。
- ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。

## ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

※欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。

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

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

## 債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	S&Pの場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1, Aa2, Aa3 }	AA { AA+, AA, AA- }
	A { A1, A2, A3 }	A { A+, A, A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
低い	C	C
		D

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

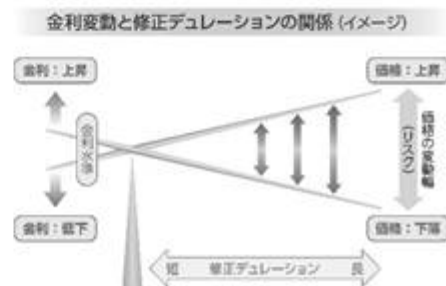
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

## 修正デュレーションについて

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



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



## 4 わが国の債券への投資にあたっては、国債に投資します。

- 残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組み入れます。

### 残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、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、ダイワ日本国債マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

## 5 内外の株式への投資にあたっては、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資します。

- ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。
  - イ. 中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します。
  - ロ. 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

## 6

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。
- 海外のリーートの運用は、コーヘン&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

ダイワ・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&amp;ステアーズ・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。
- ・ 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。
- ・ 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。
- ・ 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。

- ・ 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 2つのファンドは、それぞれ毎月または年2回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### ■ 6資産バランスファンド（分配型）

毎月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。なお、3月と9月の計算期末について、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

#### 収益分配のイメージ



### ■ 6資産バランスファンド（成長型）

毎年3月6日および9月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配を行ないます。ただし、基準価額の水準等によっては売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

#### 収益分配のイメージ



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

## 【収益分配金に関する留意事項】

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

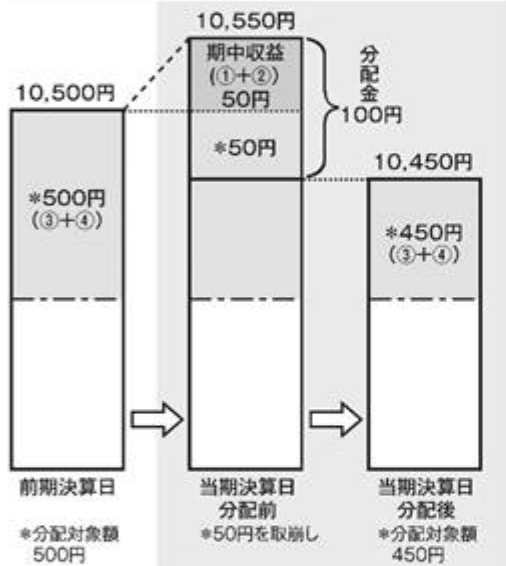
投資信託で分配金が  
支払われるイメージ



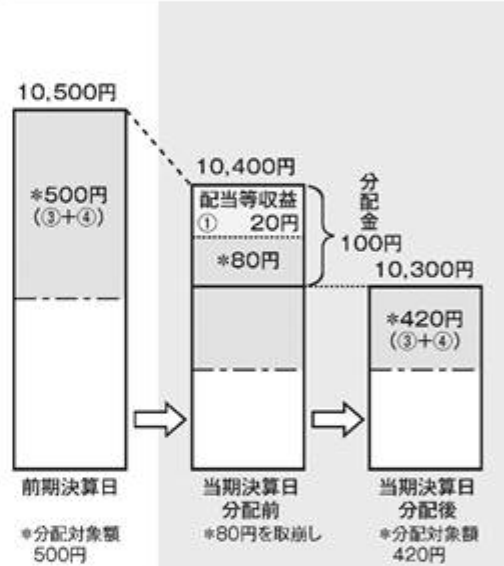
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



（前期決算日から基準価額が下落した場合）

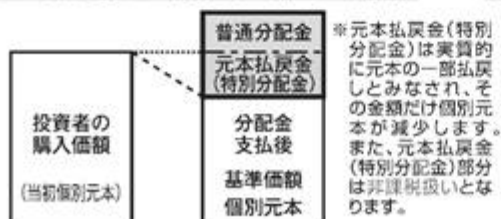


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

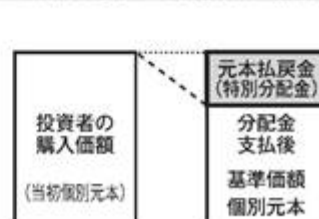
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

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

### (2) 【ファンドの沿革】

2006年3月14日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

## 収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

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

1

## 収益分配金、償還金など お申込金(5)

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

運用指図

2

## 損益 信託金(5)

受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 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> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ファミリーファンド方式で運用を行ないません。</li> <li>・なお、「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、投資顧問会社(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します。</li> </ul>	
------	--	--

(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

#### < 委託会社の概況（2024年3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

#### < 各ファンド共通 >

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
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. ダイワ外国ハーマニーストック・マザーファンドの受益証券

## 6. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券

### 投資態度

#### < 6 資産バランスファンド（分配型） >

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の50%

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

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

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

#### < 6 資産バランスファンド（成長型） >

イ．（6 資産バランスファンド（分配型）と同規定）

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の20%

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の20%

ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の25%

ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の25%

ハ．～ニ．（6 資産バランスファンド（分配型）と同規定）

## (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。）

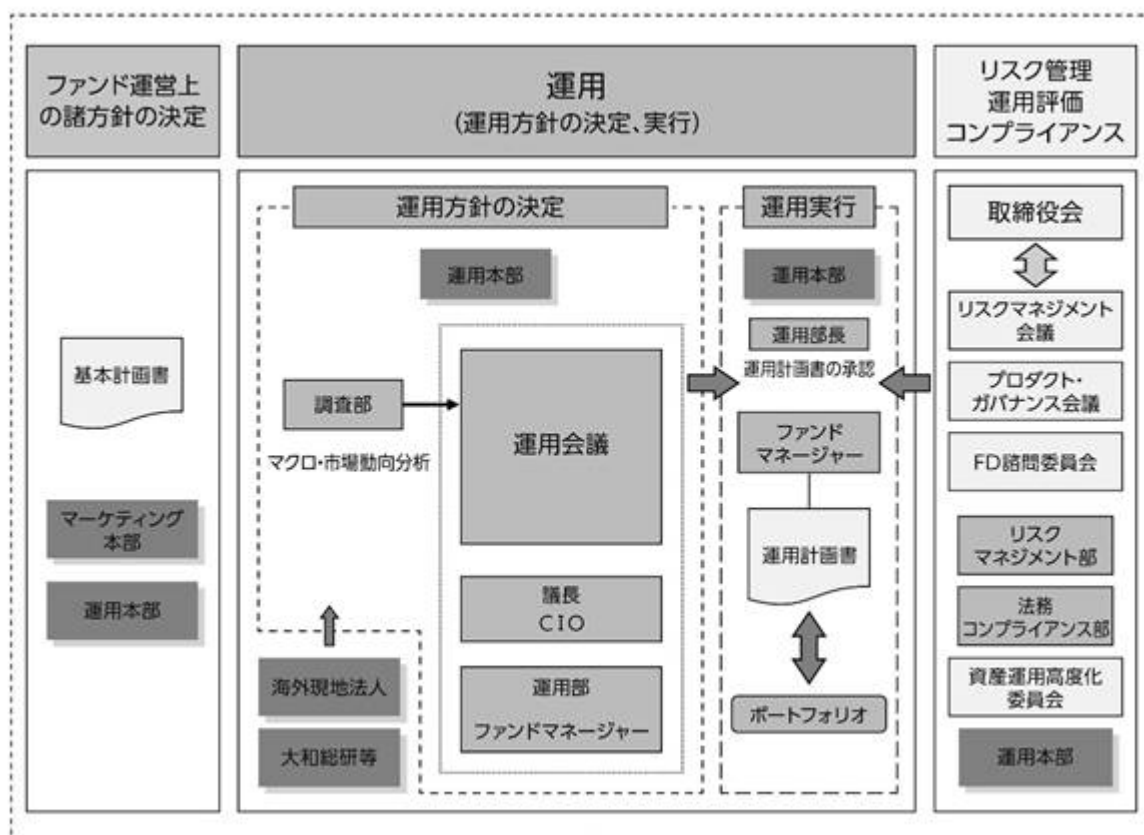
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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。

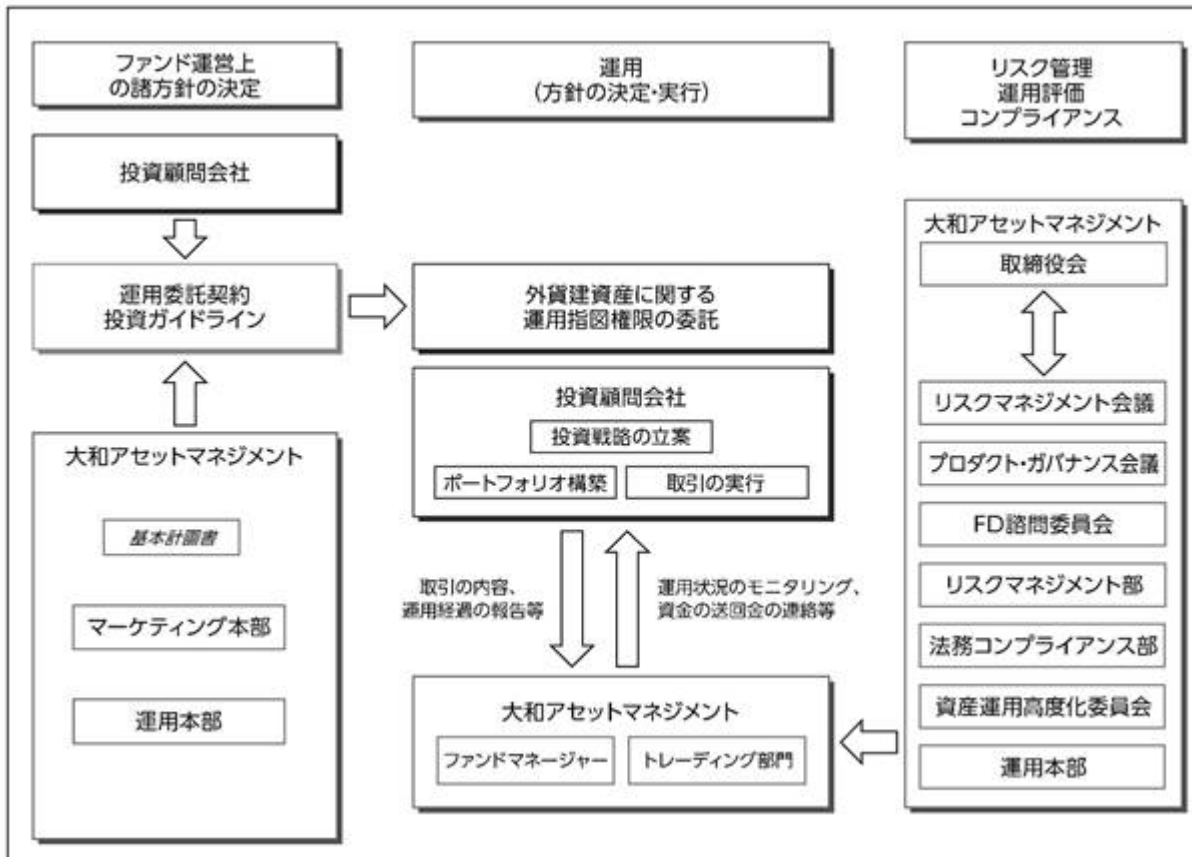
## 二．資産運用高度化委員会

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まず。）



### 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、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。

二．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3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】

##### < 6 資産バランスファンド（分配型） >

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

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。なお、3月と9月の計算期末について、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

##### < 6 資産バランスファンド（成長型） >

（ 6 資産バランスファンド（分配型）と同規定）

原則として、配当等収益等を中心に分配を行ないません。ただし、基準価額の水準等によっては売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。また、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。

（ 6 資産バランスファンド（分配型）と同規定）

#### (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. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

##### 投資態度

- イ．主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
- ロ．海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
- a．米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。
- 北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ  
    東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等
- b．ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします(ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。)
- c．国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。

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

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

八. 為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。

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

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 外貨建資産

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

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

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

#### 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。

## 2. ダイワ日本国債マザーファンド

### (1) 投資方針

## 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

## 投資態度

- イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行いません。
- ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

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

- 1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）
- 2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
- 2.～16.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

## (3) 主な投資制限

### 株式

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

### 投資信託証券

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

### 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．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ．と同規定）

### スワップ取引



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

ロ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ハ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

ホ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

#### 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、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、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、

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。

へ。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。

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

##### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(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．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．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

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。

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

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。

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

## 5. ダイワ外国ハーモニースtock・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株式および店頭登録株式（上場予定および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．主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ．ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

(a) 中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します。

(b) 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

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．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。

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

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

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。

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

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

スワップ取引

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのと同規定）

金利先渡取引および為替先渡取引

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのと同規定）

## 6. ダイワ日本ハーモニースtock・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の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ．(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定)

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90%程度以上と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時、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．(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定)

2．(ダイワ外国ハーモニースtock・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．株券または新株引受権証書

2．～10．(ダイワ外国ハーモニースtock・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．(ダイワ外国ハーモニースtock・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。

(ダイワ外国ハーモニースtock・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．(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定)

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)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.(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定)

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.(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドのハ.と同規定)

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.(ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドのハ.と同規定)

スワップ取引

(ダイワ日本国債マザーファンドの と同規定)

金利先渡取引

(ダイワ日本国債マザーファンドの と同規定)

### 3【投資リスク】

#### (1)価額変動リスク

当ファンドは、株式、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。

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します(値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。)。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合(債務不履行)、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します(利息および償還金が支払われないこともあります。)。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・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、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

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

## (3)その他の留意点

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

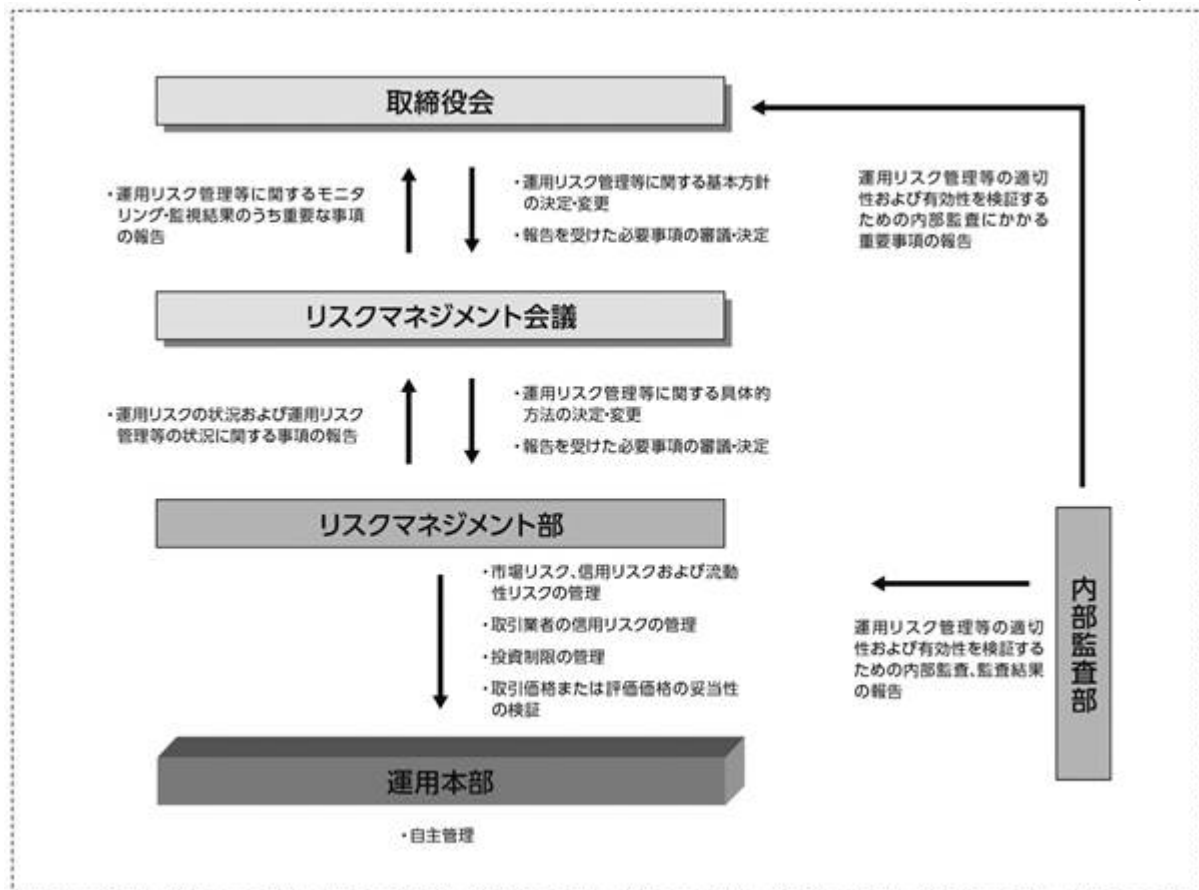
### 流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要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

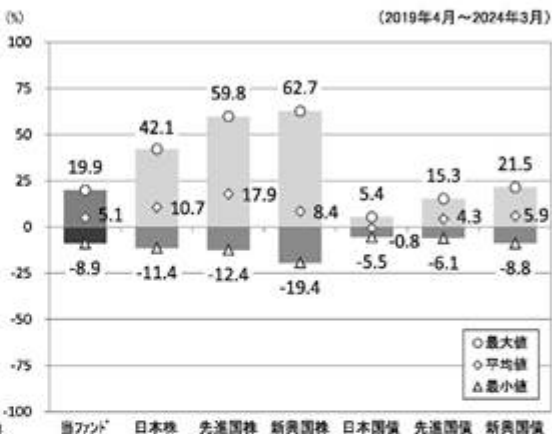
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

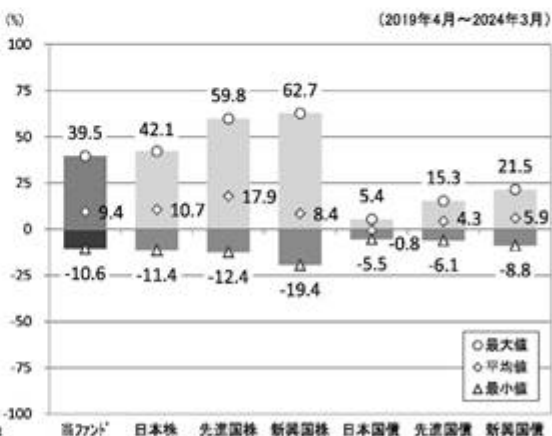
#### [6資産バランスファンド（分配型）]



### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [6資産バランスファンド（成長型）]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## &lt;スイッチング（乗換え）について&gt;

- ・「6資産バランスファンド（分配型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「6資産バランスファンド（成長型）」の受益権の取得申込みを行なうこと、および「6資産バランスファンド（成長型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「6資産バランスファンド（分配型）」の受益権の取得申込みを行なうことをいいます。
- ・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
- ・スイッチング（乗換え）にかかる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、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

## (6資産バランスファンドの構成)



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

## (2)【換金（解約）手数料】

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、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

6資産バランスファンド（分配型）	年率1.4025%（税抜1.275%）
6資産バランスファンド（成長型）	年率1.485%（税抜1.35%）

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。

#### イ．委託会社

計算期間を通じて毎日、信託報酬の総額からロ．およびハ．を除いた額とします。

#### ロ．販売会社

各販売会社ごとに、計算期間を通じて毎日、次の額を当該各販売会社にかかる各ファンドごとの取扱純資産総額により按分して得た額とします。

当該各販売会社にかかる「6資産バランスファンド（分配型）」および「6資産バランスファンド（成長型）」の取扱純資産総額の合計額に次の率を乗じて得た額

200億円以下の部分	年率0.60%（税抜）
200億円超500億円以下の部分	年率0.70%（税抜）
500億円超1,000億円以下の部分	年率0.75%（税抜）
1,000億円超2,000億円以下の部分	年率0.80%（税抜）
2,000億円超の部分	年率0.85%（税抜）

#### ハ．受託会社

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.05%（税抜）を乗じて得た額とします。

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」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。

#### ・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。

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、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。

個人の投資者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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



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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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。

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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3月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【6 資産バランスファンド（分配型）】

## (1) 【投資状況】（2024年3月29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	2,682,591,223	99.17
内 日本	2,682,591,223	99.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	22,586,277	0.83
純資産総額	2,705,177,500	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3月29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・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	631,107,374	2.0903 1,319,253,554	2.1090 1,331,005,451	49.20
2	ダイワ・REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	79,380,084	3.2934 261,431,981	3.4706 275,496,519	10.18
3	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	113,039,608	2.3819 269,259,778	2.4127 272,730,662	10.08
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	63,040,688	4.1489 261,555,127	4.3139 271,951,223	10.05
5	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	46,881,872	5.5307 259,290,700	5.7552 269,814,549	9.97
6	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	212,746,275	1.2300 261,696,262	1.2296 261,592,819	9.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.17%
合計	99.17%

(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17特定期間末 (2014年9月8日)	6,552,698,709	6,574,968,184	0.8827	0.8857
第18特定期間末 (2015年3月6日)	6,497,082,056	6,517,407,029	0.9590	0.9620
第19特定期間末 (2015年9月7日)	5,616,843,895	5,635,979,094	0.8806	0.8836
第20特定期間末 (2016年3月7日)	5,340,361,399	5,359,077,440	0.8560	0.8590
第21特定期間末 (2016年9月6日)	4,871,209,952	4,883,041,173	0.8235	0.8255
第22特定期間末 (2017年3月6日)	4,550,527,870	4,555,893,297	0.8481	0.8491
第23特定期間末 (2017年9月6日)	4,255,400,522	4,260,338,209	0.8618	0.8628
第24特定期間末 (2018年3月6日)	3,850,378,563	3,854,887,804	0.8539	0.8549
第25特定期間末 (2018年9月6日)	3,753,345,912	3,757,646,453	0.8728	0.8738

第26特定期間末 (2019年3月6日)	3,510,785,296	3,514,809,795	0.8724	0.8734
第27特定期間末 (2019年9月6日)	3,386,980,185	3,390,813,789	0.8835	0.8845
第28特定期間末 (2020年3月6日)	3,240,733,640	3,244,395,433	0.8850	0.8860
第29特定期間末 (2020年9月7日)	3,243,380,523	3,246,916,508	0.9172	0.9182
第30特定期間末 (2021年3月8日)	3,084,402,212	3,087,614,434	0.9602	0.9612
第31特定期間末 (2021年9月6日)	3,146,557,541	3,149,620,369	1.0273	1.0283
第32特定期間末 (2022年3月7日)	2,840,674,752	2,843,621,499	0.9640	0.9650
第33特定期間末 (2022年9月6日)	2,829,620,249	2,832,464,873	0.9947	0.9957
第34特定期間末 (2023年3月6日)	2,567,530,206	2,570,231,951	0.9503	0.9513
2023年3月末日	2,579,326,699	-	0.9530	-
4月末日	2,599,875,160	-	0.9667	-
5月末日	2,649,855,009	-	0.9867	-
6月末日	2,743,458,010	-	1.0284	-
7月末日	2,719,522,246	-	1.0201	-
8月末日	2,748,487,242	-	1.0358	-
第35特定期間末 (2023年9月6日)	2,743,668,369	2,746,321,518	1.0341	1.0351
9月末日	2,656,115,445	-	1.0085	-
10月末日	2,598,240,453	-	0.9891	-
11月末日	2,733,030,840	-	1.0434	-
12月末日	2,740,556,069	-	1.0571	-
2024年1月末日	2,749,815,402	-	1.0740	-
2月末日	2,764,356,736	-	1.0884	-
第36特定期間末 (2024年3月6日)	2,626,913,685	2,781,592,441	1.0360	1.0970
3月末日	2,705,177,500	-	1.0546	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第17特定期間	0.0180

第18特定期間	0.0180
第19特定期間	0.0180
第20特定期間	0.0180
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0070
第23特定期間	0.0060
第24特定期間	0.0060
第25特定期間	0.0060
第26特定期間	0.0060
第27特定期間	0.0060
第28特定期間	0.0060
第29特定期間	0.0060
第30特定期間	0.0060
第31特定期間	0.0060
第32特定期間	0.0060
第33特定期間	0.0060
第34特定期間	0.0060
第35特定期間	0.0060
第36特定期間	0.0660

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第17特定期間	6.0
第18特定期間	10.7
第19特定期間	6.3
第20特定期間	0.7
第21特定期間	2.4
第22特定期間	3.8
第23特定期間	2.3
第24特定期間	0.2
第25特定期間	2.9
第26特定期間	0.6
第27特定期間	2.0
第28特定期間	0.8
第29特定期間	4.3
第30特定期間	5.3
第31特定期間	7.6
第32特定期間	5.6

第33特定期間	3.8
第34特定期間	3.9
第35特定期間	9.4
第36特定期間	6.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第17特定期間	98,111,594	768,850,258
第18特定期間	186,967,235	835,134,645
第19特定期間	154,515,343	551,106,835
第20特定期間	174,195,213	313,914,543
第21特定期間	48,758,118	371,827,750
第22特定期間	33,814,915	583,997,839
第23特定期間	22,728,218	450,468,059
第24特定期間	19,445,597	447,892,407
第25特定期間	16,237,604	224,937,155
第26特定期間	18,121,773	294,164,207
第27特定期間	19,336,644	210,231,574
第28特定期間	20,645,914	192,457,084
第29特定期間	20,006,959	145,814,734
第30特定期間	16,347,659	340,110,410
第31特定期間	26,804,737	176,199,164
第32特定期間	17,836,518	133,917,247
第33特定期間	22,663,422	124,786,272
第34特定期間	17,165,546	160,044,934
第35特定期間	20,805,151	69,400,501
第36特定期間	14,328,196	131,760,697

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2024年3月29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	13,326,110,532	81.44
内 ユーロ	3,345,220,193	20.44
内 ノルウェー	231,600,554	1.42
内 スウェーデン	111,635,613	0.68

	内 デンマーク	586,273,747	3.58
	内 イギリス	1,944,527,034	11.88
	内 ポーランド	534,205,125	3.26
	内 チェコ	287,592,908	1.76
	内 カナダ	994,879,242	6.08
	内 アメリカ	3,976,326,650	24.30
	内 オーストラリア	1,313,849,466	8.03
特殊債券		2,376,545,027	14.52
	内 ユーロ	573,036,880	3.50
	内 カナダ	1,050,814,073	6.42
	内 オーストラリア	752,694,074	4.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		661,030,506	4.04
純資産総額		16,363,686,065	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3月29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	17,307,400	77.79 2,038,680,835	80.96 2,121,672,495	0.875000 2030/11/15	12.97
2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	91.63 1,366,548,668	94.61 1,411,035,955	1.400000 2028/04/30	8.62
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	7,400,000	86.85 1,049,235,873	89.18 1,077,381,714	2.900000 2046/10/31	6.58
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラ リア	国債証券	9,400,000	100.95 935,794,502	104.28 966,616,044	4.500000 2033/04/21	5.91
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	55.79 649,318,841	61.93 720,737,397	1.125000 2040/08/15	4.40
6	EUROPEAN INVESTMENT BANK	ユーロ	特殊債券	3,500,000	96.58 551,823,025	100.29 573,036,879	2.750000 2030/07/30	3.50
7	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	88.04 538,744,757	91.12 557,566,924	1.625000 2028/10/22	3.41
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	5,446,000	77.36 471,107,105	82.73 503,787,695	0.500000 2030/12/01	3.08



9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	3,400,000	93.25 480,065,878	93.69 482,346,534	3.375000 2033/05/15	2.95
10	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	72.88 431,449,865	77.55 459,118,065	0.250000 2031/07/31	2.81
11	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,230,000	94.37 446,366,696	96.61 456,937,270	2.250000 2025/12/15	2.79
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,520,000	92.53 445,897,657	94.44 455,101,458	1.500000 2026/07/22	2.78
13	INTL. FIN. CORP.	オーストラリア	特殊債券	5,600,000	76.55 422,737,914	81.00 447,333,615	1.250000 2031/02/06	2.73
14	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	97.44 430,692,352	98.35 434,718,754	1.750000 2025/11/15	2.66
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	3,900,000	61.63 363,941,650	65.80 388,571,961	2.250000 2052/02/15	2.37
16	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,000,000	52.36 309,828,675	58.68 347,233,420	1.750000 2051/06/21	2.12
17	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,000,000	89.58 339,735,883	91.23 345,974,265	2.750000 2028/04/25	2.11
18	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	97.47 310,267,737	107.69 342,815,753	3.750000 2045/06/22	2.09
19	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	3,000,000	92.13 309,048,430	98.18 329,335,236	3.550000 2032/09/15	2.01
20	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,600,000	62.33 264,564,700	71.13 301,926,745	1.200000 2040/10/31	1.85
21	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,400,000	92.40 247,968,640	98.58 264,541,565	3.650000 2033/06/15	1.62
22	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	17,000,000	97.63 231,363,574	97.73 231,600,554	1.750000 2025/03/13	1.42
23	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	2,500,000	89.65 221,019,523	92.07 226,980,498	1.100000 2026/12/16	1.39
24	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	2,200,000	80.94 199,100,290	89.63 220,488,425	2.750000 2048/12/01	1.35
25	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	89.76 171,639,072	97.86 187,127,892	4.250000 2046/12/07	1.14
26	Czech Republic Government Bond	チェコ	国債証券	30,000,000	91.40 177,048,198	93.96 182,012,908	1.000000 2026/06/26	1.11
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,800,000	44.38 152,778,278	50.53 173,922,238	1.250000 2051/07/31	1.06
28	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	92.45 155,065,934	101.52 170,279,362	3.500000 2045/12/01	1.04

29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,200,000	94.07 170,932,199	93.39 169,689,426	2.250000 2027/08/15	1.04
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,500,000	75.05 156,537,901	77.99 162,674,270	1.250000 2030/10/25	0.99

(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	81.44%
特殊債券	14.52%
合計	95.96%

(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。

#### ダイワ日本国債マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2024年3月29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	87,385,324,470	99.38
内 日本	87,385,324,470	99.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	545,168,284	0.62
純資産総額	87,930,492,754	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3月29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	16 30年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	116.84 4,556,916,000	117.21 4,571,463,000	2.500000 2034/09/20	5.20
2	20 30年国債	日本	国債証券	3,500,000,000	117.44 4,110,400,000	117.80 4,123,000,000	2.500000 2035/09/20	4.69
3	94 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	105.69 3,804,876,000	105.61 3,802,284,000	2.100000 2027/03/20	4.32
4	101 20年国債	日本	国債証券	3,460,000,000	108.38 3,750,224,800	108.38 3,749,982,600	2.400000 2028/03/20	4.26
5	110 20年国債	日本	国債証券	3,300,000,000	108.54 3,581,985,000	108.54 3,581,919,000	2.100000 2029/03/20	4.07
6	24 30年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	117.81 3,534,300,000	118.27 3,548,130,000	2.500000 2036/09/20	4.04
7	86 20年国債	日本	国債証券	3,400,000,000	104.26 3,544,840,000	104.18 3,542,324,000	2.300000 2026/03/20	4.03
8	12 30年国債	日本	国債証券	3,100,000,000	112.60 3,490,693,000	112.93 3,501,016,000	2.100000 2033/09/20	3.98
9	75 20年国債	日本	国債証券	3,374,000,000	102.09 3,444,820,260	101.98 3,441,007,640	2.100000 2025/03/20	3.91
10	130 20年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	109.31 3,279,300,000	109.36 3,280,860,000	1.800000 2031/09/20	3.73
11	140 20年国債	日本	国債証券	2,900,000,000	108.92 3,158,738,000	109.08 3,163,523,000	1.700000 2032/09/20	3.60
12	116 20年国債	日本	国債証券	2,800,000,000	110.70 3,099,793,000	110.65 3,098,228,000	2.200000 2030/03/20	3.52
13	27 30年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	117.87 2,946,768,000	118.51 2,962,775,000	2.500000 2037/09/20	3.37
14	125 20年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	111.88 2,909,131,000	111.85 2,908,334,000	2.200000 2031/03/20	3.31
15	30 30年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	115.50 2,887,690,000	115.79 2,894,825,000	2.300000 2039/03/20	3.29
16	28 30年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	117.86 2,828,784,000	118.52 2,844,672,000	2.500000 2038/03/20	3.24
17	121 20年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	109.43 2,845,310,000	109.39 2,844,192,000	1.900000 2030/09/20	3.23
18	29 30年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	116.50 2,796,024,000	117.25 2,814,072,000	2.400000 2038/09/20	3.20

19	70 20年国債	日本	国債証券	2,638,000,000	100.67 2,655,912,020	100.52 2,651,875,880	2.400000 2024/06/20	3.02
20	134 20年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	109.56 2,629,464,000	109.66 2,631,984,000	1.800000 2032/03/20	2.99
21	1 30年国債	日本	国債証券	2,250,000,000	113.15 2,546,077,500	113.12 2,545,245,000	2.800000 2029/09/20	2.89
22	143 20年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	108.14 2,487,375,000	108.32 2,491,452,000	1.600000 2033/03/20	2.83
23	80 20年国債	日本	国債証券	2,373,000,000	102.56 2,433,843,720	102.48 2,431,969,050	2.100000 2025/06/20	2.77
24	26 30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	116.66 2,333,340,000	117.28 2,345,620,000	2.400000 2037/03/20	2.67
25	88 20年国債	日本	国債証券	2,160,000,000	104.77 2,263,183,200	104.69 2,261,455,200	2.300000 2026/06/20	2.57
26	14 30年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	115.78 2,199,863,000	115.89 2,201,967,000	2.400000 2034/03/20	2.50
27	106 20年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	108.31 2,166,280,000	108.31 2,166,220,000	2.200000 2028/09/20	2.46
28	95 20年国債	日本	国債証券	1,805,000,000	106.72 1,926,404,300	106.68 1,925,610,100	2.300000 2027/06/20	2.19
29	22 30年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	117.61 1,764,180,000	118.11 1,771,725,000	2.500000 2036/03/20	2.01
30	15 30年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	116.69 1,283,623,000	117.05 1,287,594,000	2.500000 2034/06/20	1.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.38%
合計	99.38%

(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3月29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	97,502,062,075	98.61
内 ガーンジー	445,747,010	0.45
内 香港	1,431,604,835	1.45
内 シンガポール	6,518,419,276	6.59
内 イギリス	11,440,545,862	11.57
内 ベルギー	2,718,042,500	2.75
内 フランス	4,381,073,741	4.43
内 スペイン	967,122,158	0.98
内 カナダ	3,256,545,360	3.29
内 アメリカ	48,195,906,020	48.74
内 オーストラリア	17,208,021,782	17.40
内 ニューージーランド	939,033,531	0.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,375,519,550	1.39
純資産総額	98,877,581,625	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)	130,616,951	0.13
内 日本	130,616,951	0.13
為替予約取引(売建)	130,396,694	0.13
内 日本	130,396,694	0.13

(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3月29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	2,150,340	3,052.96 6,564,914,048	3,334.00 7,169,242,376	7.25
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	243,611	19,796.85 4,822,732,252	19,716.61 4,803,183,127	4.86
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	322,989	13,884.29 4,484,475,204	14,147.75 4,569,567,754	4.62
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	170,177	22,614.59 3,848,484,376	23,694.15 4,032,199,518	4.08
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	163,560	21,607.11 3,534,074,396	21,809.09 3,567,095,807	3.61
6	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	636,413	5,279.66 3,360,048,524	5,391.71 3,431,354,400	3.47
7	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	26,475	130,378.84 3,451,783,856	124,963.21 3,308,401,125	3.35
8	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,848,341	1,629.76 3,012,604,680	1,728.24 3,194,388,604	3.23
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	365,071	7,821.84 2,855,527,170	8,191.28 2,990,399,146	3.02
10	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,762,581	467.41 2,226,084,653	478.25 2,277,744,845	2.30
11	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	184,455	11,866.30 2,188,815,154	12,144.59 2,240,131,474	2.27
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	99,891	21,522.78 2,149,941,574	22,257.27 2,223,300,958	2.25
13	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	451,590	4,363.63 1,970,574,472	4,510.50 2,036,898,456	2.06
14	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証券	6,195,777	284.34 1,761,754,663	300.59 1,862,437,183	1.88
15	UDR INC	アメリカ	投資証券	316,058	5,552.20 1,754,818,713	5,664.24 1,790,230,926	1.81
16	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,418,612	1,184.03 1,679,685,181	1,258.61 1,785,479,305	1.81
17	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	146,064	11,622.68 1,697,656,300	12,161.38 1,776,339,808	1.80
18	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,498,477	389.02 1,750,005,170	392.38 1,765,134,898	1.79

19	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,284,100	1,310.52 1,682,847,592	1,355.88 1,741,095,139	1.76
20	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	3,262,234	491.07 1,602,010,696	515.73 1,682,432,919	1.70
21	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	7,394,200	218.61 1,616,479,336	221.97 1,641,348,249	1.66
22	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	6,712,188	212.99 1,429,679,935	232.71 1,562,057,706	1.58
23	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	イギリス	投資証券	3,965,237	366.56 1,453,531,929	388.55 1,540,728,681	1.56
24	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	41,369	35,903.85 1,485,306,507	37,066.68 1,533,411,572	1.55
25	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	3,351,907	427.96 1,434,506,924	450.64 1,510,529,180	1.53
26	LINK REIT	香港	投資証券	2,199,792	718.48 1,580,508,756	650.79 1,431,604,835	1.45
27	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	70,446	19,849.85 1,398,342,604	19,468.29 1,371,463,707	1.39
28	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	154,920	8,568.00 1,327,354,606	8,730.12 1,352,470,934	1.37
29	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	投資証券	45,180	30,159.35 1,362,599,790	29,917.10 1,351,654,664	1.37
30	KLEPIERRE	フランス	投資証券	330,356	3,883.47 1,282,930,787	3,917.76 1,294,255,523	1.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.61%
合計	98.61%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年4月	買建	863,251	130,730,060	130,616,951	0.13%
		ユーロ売/円買 2024年4月	売建	575,310	94,183,356	93,865,475	0.09%
		シンガポール・ドル売/円買 2024年4月	売建	325,990	36,546,704	36,531,219	0.04%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資状況 (2024年3月29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	166,083,897,700	97.41
内 日本	166,083,897,700	97.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,417,632,891	2.59
純資産総額	170,501,530,591	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,516,474,000	1.48
内 日本	2,516,474,000	1.48

(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3月29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	19,432	606,479.80 11,785,115,558	598,000.00 11,620,336,000	6.82
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	42,686	274,256.23 11,706,901,549	269,000.00 11,482,534,000	6.73
3	GLP投資法人	日本	投資証券	81,945	135,226.96 11,081,173,734	125,600.00 10,292,292,000	6.04
4	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	61,535	159,749.77 9,830,202,289	158,700.00 9,765,604,500	5.73
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	97,371	97,243.57 9,468,703,996	94,700.00 9,221,033,700	5.41
6	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	32,999	267,945.84 8,841,944,908	258,800.00 8,540,141,200	5.01
7	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	91,792	67,061.04 6,155,667,889	79,700.00 7,315,822,400	4.29
8	野村不動産マスターF	日本	投資証券	46,889	163,088.15 7,647,040,606	150,300.00 7,047,416,700	4.13
9	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	12,577	564,560.02 7,100,471,375	538,000.00 6,766,426,000	3.97
10	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,942	607,878.72 6,043,530,296	645,000.00 6,412,590,000	3.76
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	37,219	169,995.06 6,327,046,222	164,400.00 6,118,803,600	3.59
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	16,219	344,672.67 5,590,246,139	332,000.00 5,384,708,000	3.16
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	14,582	324,684.13 4,734,544,056	334,000.00 4,870,388,000	2.86
14	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	29,742	149,030.46 4,432,464,257	153,200.00 4,556,474,400	2.67
15	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	11,475	376,457.61 4,319,851,182	383,000.00 4,394,925,000	2.58
16	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	60,518	58,165.32 3,520,048,951	68,000.00 4,115,224,000	2.41
17	イオンリート投資	日本	投資証券	25,661	142,676.59 3,661,224,125	139,300.00 3,574,577,300	2.10
18	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,966	341,332.86 3,060,390,500	352,500.00 3,160,515,000	1.85

19	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	20,074	150,617.88 3,023,503,355	153,900.00 3,089,388,600	1.81
20	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	9,109	316,550.17 2,883,455,592	325,500.00 2,964,979,500	1.74
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	18,641	149,999.18 2,796,134,829	154,100.00 2,872,578,100	1.68
22	産業ファンド	日本	投資証券	20,480	136,284.18 2,791,100,222	135,600.00 2,777,088,000	1.63
23	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	20,206	126,674.69 2,559,588,863	122,700.00 2,479,276,200	1.45
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	105,400.00 2,414,819,400	1.42
25	森ヒルズリート	日本	投資証券	17,125	138,821.05 2,377,310,616	136,900.00 2,344,412,500	1.38
26	CREロジスティクスファンド	日本	投資証券	15,529	155,146.76 2,409,274,068	150,500.00 2,337,114,500	1.37
27	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	3,360	649,951.29 2,183,836,362	590,000.00 1,982,400,000	1.16
28	API投資法人	日本	投資証券	4,654	399,077.53 1,857,306,859	408,500.00 1,901,159,000	1.12
29	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,948	451,213.50 1,781,390,934	454,500.00 1,794,366,000	1.05
30	いちごオフィスリート投資法人	日本	投資証券	21,648	83,879.52 1,815,823,888	81,200.00 1,757,817,600	1.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.41%
合計	97.41%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

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 0606月	買建	1,409	2,384,783,990	2,516,474,000	1.48%

(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。

### ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,430,592,979	99.32
内 デンマーク	22,657,342	1.57
内 イギリス	6,512,466	0.45
内 オランダ	19,516,126	1.35
内 フランス	28,931,270	2.01
内 ドイツ	16,703,452	1.16
内 スイス	17,547,800	1.22
内 スペイン	1,876,444	0.13
内 アメリカ	1,315,434,246	91.32
内 オーストラリア	1,413,833	0.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,856,229	0.68
純資産総額	1,440,449,208	100.00

##### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	1,000,040	0.07
内 日本	1,000,040	0.07

(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3月29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	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	785	130,158.09 102,174,103	136,808.01 107,394,295	7.46
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,570	60,965.23 95,715,421	63,701.21 100,010,908	6.94
3	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	2,900	25,757.86 74,697,821	25,963.78 75,294,982	5.23
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,300	26,363.50 60,636,071	27,311.33 62,816,072	4.36
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	750	74,224.21 55,668,158	73,521.66 55,141,251	3.83
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	2,350	20,255.62 47,600,730	23,053.68 54,176,164	3.76
7	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	270	117,734.90 31,788,424	117,790.92 31,803,549	2.21
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	130	203,305.77 26,429,751	200,680.32 26,088,443	1.81
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	810	28,548.35 23,124,168	30,327.42 24,565,213	1.71
10	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	1,175	18,707.40 21,981,195	19,282.84 22,657,342	1.57
11	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	134	146,834.38 19,675,807	145,642.72 19,516,126	1.35
12	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	420	45,233.73 18,998,170	45,601.66 19,152,699	1.33
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	425	42,300.92 17,977,893	42,255.50 17,958,589	1.25
14	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	240	70,787.20 16,988,929	72,914.51 17,499,483	1.21
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	230	71,639.64 16,477,118	74,902.52 17,227,581	1.20

16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	270	60,676.04 16,382,532	63,670.93 17,191,152	1.19
17	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	355	44,201.12 15,691,398	47,342.87 16,806,722	1.17
18	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	925	14,303.70 13,230,925	17,849.72 16,510,996	1.15
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	610	24,122.64 14,714,811	24,566.27 14,985,426	1.04
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	250	57,301.11 14,325,279	58,080.87 14,520,219	1.01
21	APPLIED MATERIALS INC	アメリカ	株式	情報技術	465	31,400.91 14,601,428	31,225.28 14,519,757	1.01
22	KKR & CO INC	アメリカ	株式	金融	950	14,627.72 13,896,334	15,228.81 14,467,377	1.00
23	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	127	115,064.02 14,613,132	110,927.50 14,087,794	0.98
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	700	18,597.69 13,018,383	19,978.54 13,984,985	0.97
25	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	118	112,066.11 13,223,801	115,434.98 13,621,328	0.95
26	AMERICAN EXPRESS CO	アメリカ	株式	金融	385	32,886.25 12,661,207	34,474.54 13,272,699	0.92
27	KLA CORP	アメリカ	株式	情報技術	120	106,875.77 12,825,093	105,770.48 12,692,458	0.88
28	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	455	27,126.61 12,342,610	27,571.76 12,545,151	0.87
29	CATERPILLAR INC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	225	50,499.77 11,362,450	55,481.16 12,483,262	0.87
30	LINDE PLC	アメリカ	株式	素材	175	69,793.95 12,213,942	70,302.69 12,302,971	0.85

(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	99.32%
合計	99.32%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.66%
素材	1.39%
資本財・サービス	10.95%
一般消費財・サービス	11.13%
生活必需品	3.78%
ヘルスケア	12.16%
金融	13.02%
情報技術	35.49%
コミュニケーション・サービス	9.34%
公益事業	0.40%
合計	99.32%

(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	米ドル売/円買 2024年4 月	売建	6,610	1,000,000	1,000,040	0.07%

(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。

#### ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

##### (1) 投資状況（2024年3月29日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,381,658,730	97.46
内 日本	1,381,658,730	97.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	35,981,784	2.54
純資産総額	1,417,640,514	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3月29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	22,600	3,779.05 85,406,659	3,792.00 85,699,200	6.05
2	日立	日本	株式	電気機器	5,800	13,080.00 75,864,000	13,905.00 80,649,000	5.69
3	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1,900	39,600.00 75,240,000	39,570.00 75,183,000	5.30
4	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	5,500	12,955.00 71,252,500	12,985.00 71,417,500	5.04
5	任天堂	日本	株式	その他製品	7,900	8,329.00 65,799,100	8,196.00 64,748,400	4.57
6	アシックス	日本	株式	その他製品	8,600	6,700.00 57,620,000	7,301.00 62,788,600	4.43
7	ディスコ	日本	株式	機械	1,000	52,350.00 52,350,000	57,190.00 57,190,000	4.03
8	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	7,900	6,207.00 49,035,300	6,707.00 52,985,300	3.74
9	キーエンス	日本	株式	電気機器	700	74,100.00 51,870,000	69,540.00 48,678,000	3.43
10	信越化学	日本	株式	化学	7,300	6,585.00 48,070,500	6,584.00 48,063,200	3.39
11	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	1,000	43,870.00 43,870,000	47,140.00 47,140,000	3.33
12	味の素	日本	株式	食料品	7,600	5,553.00 42,202,800	5,660.00 43,016,000	3.03
13	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	27,100	1,608.00 43,576,800	1,557.00 42,194,700	2.98
14	第一三共	日本	株式	医薬品	8,800	4,930.00 43,384,000	4,777.00 42,037,600	2.97
15	野村総合研究所	日本	株式	情報・通信業	9,800	4,394.00 43,061,200	4,243.00 41,581,400	2.93
16	住友電工	日本	株式	非鉄金属	17,700	2,263.00 40,055,100	2,347.50 41,550,750	2.93

17	三井不動産	日本	株式	不動産業	24,000	1,486.78 35,682,777	1,647.50 39,540,000	2.79
18	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	7,400	5,209.00 38,546,600	4,849.00 35,882,600	2.53
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	7,200	4,415.00 31,788,000	4,703.00 33,861,600	2.39
20	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,600	8,773.00 31,582,800	8,909.00 32,072,400	2.26
21	デンソー	日本	株式	輸送用機器	11,000	2,869.00 31,559,028	2,883.00 31,713,000	2.24
22	日本酸素HLDGS	日本	株式	化学	6,600	4,894.00 32,300,400	4,748.00 31,336,800	2.21
23	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	158,100	182.10 28,790,010	179.80 28,426,380	2.01
24	テルモ	日本	株式	精密機器	10,400	2,908.00 30,243,200	2,729.00 28,381,600	2.00
25	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	8,100	3,366.14 27,265,794	3,370.00 27,297,000	1.93
26	SMC	日本	株式	機械	300	90,980.00 27,294,000	84,830.00 25,449,000	1.80
27	ダイキン工業	日本	株式	機械	1,200	21,150.00 25,380,000	20,600.00 24,720,000	1.74
28	大和ハウス	日本	株式	建設業	5,300	4,345.00 23,028,500	4,528.00 23,998,400	1.69
29	ユニ・チャーム	日本	株式	化学	4,500	4,896.00 22,032,000	4,834.00 21,753,000	1.53
30	村田製作所	日本	株式	電気機器	7,200	2,965.00 21,348,000	2,824.00 20,332,800	1.43

(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	97.46%
合計	97.46%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	1.69%



食料品	3.03%
化学	10.11%
医薬品	2.97%
非鉄金属	2.93%
機械	7.57%
電気機器	22.75%
輸送用機器	8.28%
精密機器	3.32%
その他製品	9.85%
情報・通信業	4.94%
小売業	3.33%
銀行業	5.24%
保険業	2.39%
不動産業	2.79%
サービス業	6.27%
合計	97.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

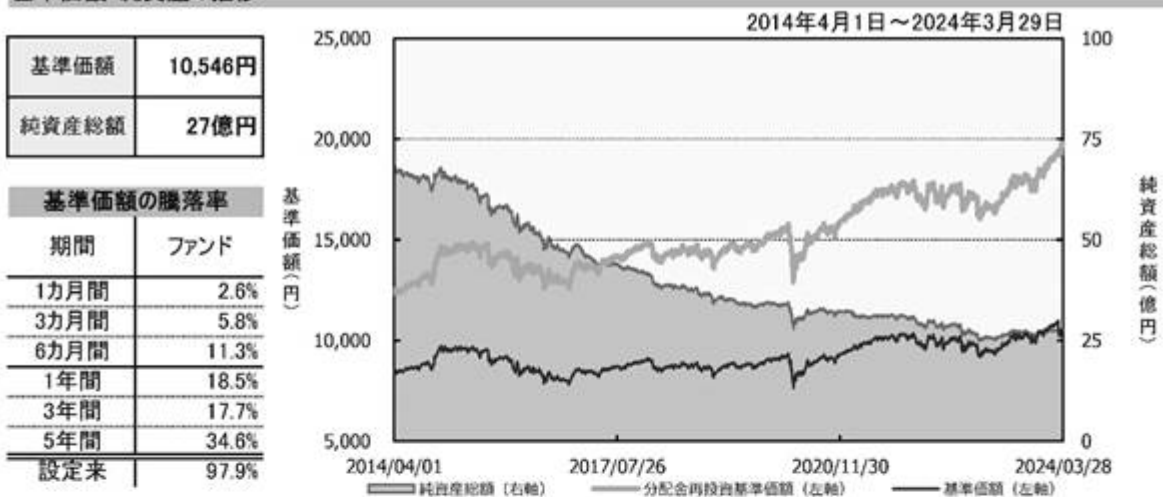
#### (参考情報) 運用実績

## ● 6資産バランスファンド(分配型)

2024年3月29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: 720円 設定来分配金合計額: 5,400円

決算期	第205期 23年4月	第206期 23年5月	第207期 23年6月	第208期 23年7月	第209期 23年8月	第210期 23年9月	第211期 23年10月	第212期 23年11月	第213期 23年12月	第214期 24年1月	第215期 24年2月	第216期 24年3月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	610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	相入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	43	47.2%	日本円	30.9%	直接利回り(%)	NVIDIA CORP	アメリカ	0.7%	
国内リート・先物	50	10.1%	米ドル	26.6%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%	
外国リート	64	9.9%	ユーロ	13.8%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	0.6%	
外国株式	141	9.9%	豪ドル	8.1%	残存年数	日立	日本	0.6%	
国内株式	35	9.8%	英ポンド	7.2%	債券格付別構成 比率	東京エレクトロン	日本	0.5%	
国内債券	30	9.6%	カナダ・ドル	6.6%	AAA	79.7%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.7%
			デンマーク・クローネ	2.0%	AA	17.5%	日本ビルファンド	日本	0.7%
			ポーランド・ズロチ	1.7%	A	2.8%	日本プロロジスリート	日本	0.7%
			チェコ・コルナ	0.9%	BBB	-	GLP投資法人	日本	0.6%
コール・ローン、その他		3.6%	その他	2.2%	BB	-	KDX不動産投資法人	日本	0.6%
合計	363	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.5%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

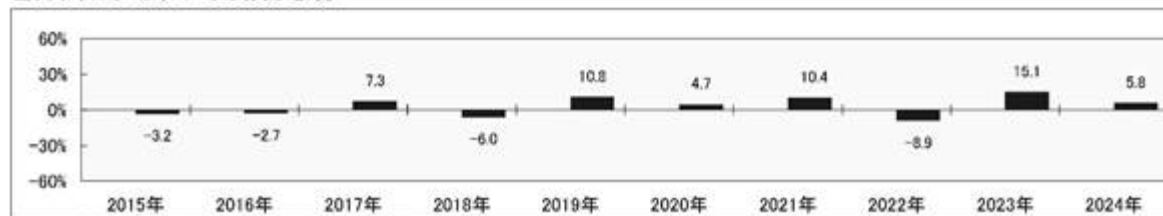
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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3月29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。

## 【6資産バランスファンド(成長型)】

## (1) 【投資状況】 (2024年3月29日現在)

## 投資状況

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

親投資信託受益証券	4,317,662,197	99.19
内 日本	4,317,662,197	99.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	35,302,031	0.81
純資産総額	4,352,964,228	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3月29日現在）

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価	評価単価	投資比率
				または 額面金額	簿価 (円)	時価 (円)	
1	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	188,751,737	5.5279 1,043,417,576	5.7552 1,086,303,996	24.96
2	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	440,245,722	2.3812 1,048,315,542	2.4127 1,062,180,853	24.40
3	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	254,125,873	3.2824 834,166,791	3.4706 881,969,254	20.26
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	201,326,716	4.1494 835,394,841	4.3139 868,503,320	19.95
5	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	99,928,406	2.0897 208,830,042	2.1090 210,749,008	4.84
6	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	169,124,729	1.2299 208,011,794	1.2296 207,955,766	4.78

(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	99.19%
合計	99.19%

(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17計算期間末 (2014年9月8日)	6,329,549,470	6,451,156,527	1.0410	1.0610
第18計算期間末 (2015年3月6日)	6,140,633,937	6,244,032,295	1.1878	1.2078
第19計算期間末 (2015年9月7日)	5,349,482,161	5,449,078,140	1.0742	1.0942
第20計算期間末 (2016年3月7日)	5,262,096,277	5,321,009,184	1.0718	1.0838
第21計算期間末 (2016年9月6日)	4,654,475,204	4,707,383,511	1.0557	1.0677
第22計算期間末 (2017年3月6日)	4,628,690,383	4,711,090,976	1.1235	1.1435
第23計算期間末 (2017年9月6日)	4,363,813,413	4,442,364,406	1.1111	1.1311
第24計算期間末 (2018年3月6日)	4,189,876,711	4,263,680,966	1.1354	1.1554
第25計算期間末 (2018年9月6日)	4,178,639,233	4,249,681,109	1.1764	1.1964
第26計算期間末 (2019年3月6日)	4,005,637,453	4,075,168,070	1.1522	1.1722
第27計算期間末 (2019年9月6日)	3,912,378,210	3,979,178,634	1.1714	1.1914
第28計算期間末 (2020年3月6日)	3,654,356,692	3,718,048,625	1.1475	1.1675
第29計算期間末 (2020年9月7日)	3,642,396,245	3,704,453,371	1.1739	1.1939

第30計算期間末 (2021年3月8日)	3,686,100,347	3,861,123,622	1.2636	1.3236
第31計算期間末 (2021年9月6日)	3,983,993,188	4,278,572,558	1.3524	1.4524
第32計算期間末 (2022年3月7日)	3,753,137,337	3,829,779,813	1.2242	1.2492
第33計算期間末 (2022年9月6日)	3,821,809,657	3,974,501,214	1.2515	1.3015
第34計算期間末 (2023年3月6日)	3,685,505,729	3,746,682,357	1.2049	1.2249
2023年3月末日	3,632,111,514	-	1.1812	-
4月末日	3,743,062,516	-	1.2167	-
5月末日	3,850,721,902	-	1.2579	-
6月末日	4,038,610,615	-	1.3212	-
7月末日	4,056,960,437	-	1.3317	-
8月末日	4,122,175,303	-	1.3528	-
第35計算期間末 (2023年9月6日)	3,964,483,271	4,147,105,708	1.3025	1.3625
9月末日	3,921,859,753	-	1.2574	-
10月末日	3,801,444,792	-	1.2165	-
11月末日	4,045,529,798	-	1.3026	-
12月末日	4,100,745,328	-	1.3230	-
2024年1月末日	4,209,481,883	-	1.3745	-
2月末日	4,336,671,709	-	1.4127	-
第36計算期間末 (2024年3月6日)	4,052,291,233	4,357,726,485	1.3267	1.4267
3月末日	4,352,964,228	-	1.3694	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第17計算期間	0.0200
第18計算期間	0.0200
第19計算期間	0.0200
第20計算期間	0.0120
第21計算期間	0.0120
第22計算期間	0.0200
第23計算期間	0.0200
第24計算期間	0.0200
第25計算期間	0.0200

第26計算期間	0.0200
第27計算期間	0.0200
第28計算期間	0.0200
第29計算期間	0.0200
第30計算期間	0.0600
第31計算期間	0.1000
第32計算期間	0.0250
第33計算期間	0.0500
第34計算期間	0.0200
第35計算期間	0.0600
第36計算期間	0.1000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第17計算期間	7.6
第18計算期間	16.0
第19計算期間	7.9
第20計算期間	0.9
第21計算期間	0.4
第22計算期間	8.3
第23計算期間	0.7
第24計算期間	4.0
第25計算期間	5.4
第26計算期間	0.4
第27計算期間	3.4
第28計算期間	0.3
第29計算期間	4.0
第30計算期間	12.8
第31計算期間	14.9
第32計算期間	7.6
第33計算期間	6.3
第34計算期間	2.1
第35計算期間	13.1
第36計算期間	9.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第17計算期間	108,753,929	644,492,915

第18計算期間	184,379,112	1,094,814,032
第19計算期間	494,944,170	685,063,111
第20計算期間	159,604,753	229,994,788
第21計算期間	71,066,299	571,449,623
第22計算期間	72,368,248	361,364,208
第23計算期間	73,472,329	265,952,331
第24計算期間	72,412,106	309,748,996
第25計算期間	69,013,373	207,132,341
第26計算期間	89,085,587	164,648,508
第27計算期間	54,343,038	190,852,687
第28計算期間	59,843,886	215,268,440
第29計算期間	71,640,948	153,381,303
第30計算期間	59,419,717	245,221,459
第31計算期間	123,956,060	95,216,953
第32計算期間	182,216,429	62,311,072
第33計算期間	78,927,907	90,795,820
第34計算期間	113,974,442	108,974,187
第35計算期間	62,370,138	77,494,252
第36計算期間	141,691,191	131,045,952

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワ日本国債マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績



## ● 6資産バランスファンド(成長型)

2024年3月29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: 1,600円 設定来分配金合計額: 8,010円

決算期	第25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期
	18年9月	19年3月	19年9月	20年3月	20年9月	21年3月	21年9月	22年3月	22年9月	23年3月	23年9月	24年3月
分配金	200円	200円	200円	200円	200円	600円	1,000円	250円	500円	200円	600円	1,000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。分配金が支払れない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
外国株式	141	24.8%	日本円	50.4%	直接利回り(%)	NVIDIA CORP	アメリカ	1.9%
国内株式	35	23.8%	米ドル	34.2%	最終利回り(%)	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.7%
国内リート・先物	50	20.0%	ユーロ	4.1%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	1.5%
外国リート	64	19.7%	豪ドル	4.1%	残存年数	日立	日本	1.4%
国内債券	30	4.7%	英ポンド	3.1%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	1.3%
外国債券	43	4.6%	カナダ・ドル	1.3%	AAA	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.4%
			シンガポール・ドル	1.1%	AA	日本ビルファンド	日本	1.4%
			デンマーク・クローネ	0.6%	A	日本プロロジスリート	日本	1.4%
			スイス・フラン	0.3%	BBB	GLP投資法人	日本	1.2%
コール・ローン、その他		2.6%	その他	0.9%	BB	KDX不動産投資法人	日本	1.2%
合計	363	-	合計	100.0%	合計	合計		14.3%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

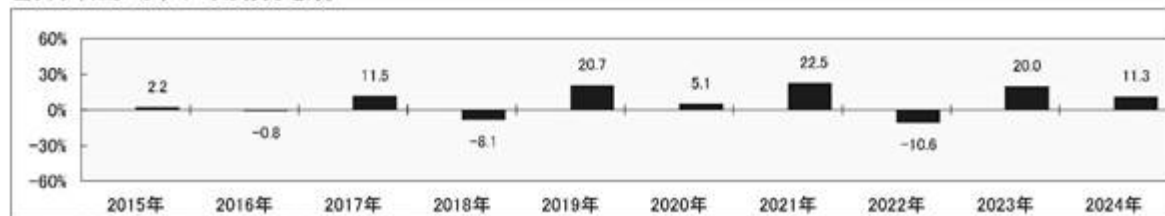
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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3月29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
6資産バランスファンド(分配型)	1.44%	1.40%	0.03%
6資産バランスファンド(成長型)	1.52%	1.49%	0.03%

※対象期間は2023年9月7日～2024年3月6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】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

（2024年11月4日まで）

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。

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分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。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

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せん。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せん。

### 2【換金（解約）手続等】

（2024年11月4日まで）

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。

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

#### <一部解約>

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

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：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：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】

< 6 資産バランスファンド(分配型) >

毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年3月14日から2006年4月6日までとします。

< 6 資産バランスファンド(成長型) >

毎年3月7日から9月6日まで、および9月7日から翌年3月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年3月14日から2006年9月6日までとします。

< 各ファンド共通 >

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、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
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「6資産バランスファンド（分配型）」については毎年3月および9月の計算期間の末日ならびに償還時に、「6資産バランスファンド（成長型）」については毎計算期間の末日ならびに償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 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。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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



### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【6 資産バランスファンド（分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2023年9月7日から2024年3月6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】

## 6 資産バランスファンド（分配型）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2023年9月6日現在	当期 2024年3月6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,319,166	181,025,035
親投資信託受益証券	2,721,743,048	2,604,411,271
未収入金	-	4,000,000
流動資産合計	2,750,062,214	2,789,436,306
資産合計	2,750,062,214	2,789,436,306
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,653,149	154,678,756
未払解約金	512,663	4,664,159
未払受託者報酬	122,264	120,324
未払委託者報酬	2,995,776	2,948,218
その他未払費用	109,993	111,164
流動負債合計	6,393,845	162,522,621
負債合計	6,393,845	162,522,621
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,653,149,824	1 2,535,717,323
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	90,518,545	91,196,362
（分配準備積立金）	263,691,652	249,206,493
元本等合計	2,743,668,369	2,626,913,685
純資産合計	2,743,668,369	2,626,913,685
負債純資産合計	2,750,062,214	2,789,436,306

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	2023年3月7日 至 2023年9月6日	自	2023年9月7日 至 2024年3月6日
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		-
有価証券売買等損益		259,631,588		193,668,223
<b>営業収益合計</b>		<b>259,631,590</b>		<b>193,668,223</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,321		1,830
受託者報酬		733,922		741,640
委託者報酬	1	17,982,250	1	18,171,201
その他費用		109,993		111,164
<b>営業費用合計</b>		<b>18,831,486</b>		<b>19,025,835</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>240,800,104</b>		<b>174,642,388</b>
経常利益又は経常損失（ ）		240,800,104		174,642,388
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>240,800,104</b>		<b>174,642,388</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		653,179		1,023,968
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>134,214,968</b>		<b>90,518,545</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,092,483		564,921
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,092,483		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		564,921
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>441,071</b>		<b>5,805,739</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		5,805,739
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		441,071		-
<b>分配金</b>		<b>2 16,064,824</b>		<b>2 167,699,785</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>90,518,545</b>		<b>91,196,362</b>

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期
	自2023年9月7日 至2024年3月6日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期	当期
	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首元本額	2,701,745,174円	2,653,149,824円
期中追加設定元本額	20,805,151円	14,328,196円
期中一部解約元本額	69,400,501円	131,760,697円
2. 特定期間末日における受益権の 総数	2,653,149,824口	2,535,717,323口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	自2023年3月7日 至2023年9月6日	自2023年9月7日 至2024年3月6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	651,457円	670,130円

## 2. 2 分配金の計算過程

(自2023年3月7日至2023年4月6日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,929,412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(22,074,979円)及び分配準備積立金(261,594,211円)より分配対象額は287,598,602円(1万口当たり1,062.95円)であり、うち2,705,671円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2023年4月7日至2023年5月8日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,854,270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(22,173,874円)及び分配準備積立金(261,081,637円)より分配対象額は287,109,781円(1万口当たり1,067.28円)であり、うち2,690,110円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2023年9月7日至2023年10月6日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,103,745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(22,995,814円)及び分配準備積立金(261,596,761円)より分配対象額は287,696,320円(1万口当たり1,092.29円)であり、うち2,633,892円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2023年10月7日至2023年11月6日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,962,587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(23,266,750円)及び分配準備積立金(261,033,459円)より分配対象額は288,262,796円(1万口当たり1,097.38円)であり、うち2,626,826円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

<p>(自2023年5月9日至2023年6月6日)</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(4,275,308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(22,411,470円)及び分配準備積立金(261,440,843円)より分配対象額は288,127,621円(1万口当たり1,073.21円)であり、うち2,684,733円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2023年11月7日至2023年12月6日)</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(4,604,520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(17,982,514円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,378,291円)及び分配準備積立金(261,222,543円)より分配対象額は307,187,868円(1万口当たり1,173.68円)であり、うち2,617,299円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2023年6月7日至2023年7月6日)</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(5,550,005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(22,644,479円)及び分配準備積立金(260,970,775円)より分配対象額は289,165,259円(1万口当たり1,084.03円)であり、うち2,667,506円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2023年12月7日至2024年1月9日)</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(5,461,453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(22,778,284円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,325,788円)及び分配準備積立金(278,096,246円)より分配対象額は329,661,771円(1万口当たり1,272.71円)であり、うち2,590,230円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>

<p>(自2023年7月7日至2023年8月7日)</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(1,182,769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(22,935,681円)及び分配準備積立金(263,150,186円)より分配対象額は287,268,636円(1万口当たり1,078.47円)であり、うち2,663,655円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年1月10日至2024年2月6日)</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(3,632,670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(39,591,364円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,441,440円)及び分配準備積立金(298,904,419円)より分配対象額は365,569,893円(1万口当たり1,432.05円)であり、うち2,552,782円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2023年8月8日至2023年9月6日)</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(5,840,915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(22,979,374円)及び分配準備積立金(260,503,886円)より分配対象額は289,324,175円(1万口当たり1,090.49円)であり、うち2,653,149円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年2月7日至2024年3月6日)</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(5,869,505円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(60,918,220円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,493,778円)及び分配準備積立金(337,097,524円)より分配対象額は427,379,027円(1万口当たり1,685.44円)であり、うち154,678,756円(1万口当たり1610円)を分配金額としております。</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	当期 自2023年9月7日 至2024年3月6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	当期 2024年3月6日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2023年9月6日現在	当期 2024年3月6日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）



親投資信託受益証券	66,448,891	64,046,576
合計	66,448,891	64,046,576

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期 2023年9月6日現在	当期 2024年3月6日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自2023年9月7日 至2024年3月6日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2023年9月6日現在	当期 2024年3月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0341円 (10,341円)	1.0360円 (10,360円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	626,766,251	1,310,254,847	
	ダイワ日本国債マザーファンド	210,305,067	258,696,262	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	63,036,626	261,551,568	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	74,993,956	246,370,144	

	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	112,202,555	267,288,926	
	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	47,057,993	260,249,524	
	親投資信託受益証券 合計		2,604,411,271	
	合計		2,604,411,271	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

### 「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2023年9月6日現在 金額（円）	2024年3月6日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	102,919,328	290,198,383
コール・ローン	27,892,717	72,742,475
国債証券	14,074,326,882	13,395,757,255
特殊債券	2,234,426,523	2,347,839,880
派生商品評価勘定	7,826,208	-
未収利息	104,549,061	108,781,882

前払費用		3,639,396	24,385,195
差入委託証拠金		169,723,984	176,815,715
流動資産合計		16,725,304,099	16,416,520,785
資産合計		16,725,304,099	16,416,520,785
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		288,430	-
未払解約金		33,058,680	39,873,336
流動負債合計		33,347,110	39,873,336
負債合計		33,347,110	39,873,336
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,523,703,703	7,833,881,834
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,168,253,286	8,542,765,615
元本等合計		16,691,956,989	16,376,647,449
純資産合計		16,691,956,989	16,376,647,449
負債純資産合計		16,725,304,099	16,416,520,785

## 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9月7日 至2024年3月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
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

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>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>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9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	9,156,762,595円	8,523,703,703円
期中追加設定元本額	176,410,394円	175,183,554円
期中一部解約元本額	809,469,286円	865,005,423円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,211,900,440円	1,081,059,833円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	526,905,044円	476,019,474円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	42,554,782円	-円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	143,039,131円	154,827,408円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	222,864,942円	201,701,776円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	311,865,721円	318,708,089円

6 資産バランスファンド（分配型）	692,333,671円	626,766,251円
6 資産バランスファンド（成長型）	98,430,725円	95,589,592円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	3,237,304,033円	2,978,975,931円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	37,544,149円	35,032,054円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	133,445,443円	120,963,869円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	639,672,290円	650,164,813円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	626,471,303円	584,493,697円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	12,999,879円	11,136,403円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	485,533,181円	416,135,657円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	100,838,969円	82,306,987円
計	8,523,703,703円	7,833,881,834円
2. 期末日における受益権の総数	8,523,703,703口	7,833,881,834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9月7日 至2024年3月6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、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	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3月6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9月6日現在	2024年3月6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	719,672,564	605,184,709
特殊債券	65,691,389	95,133,910
合計	785,363,953	700,318,619

(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9月6日現在				2024年3月6日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売建	729,358,254	-	724,526,592	4,831,662	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	301,327,254	-	297,823,182	3,504,072	-	-	-	-
ユーロ	428,031,000	-	426,703,410	1,327,590	-	-	-	-
買建	729,358,254	-	732,064,370	2,706,116	-	-	-	-
アメリカ・ドル	317,060,000	-	319,453,800	2,393,800	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	110,971,000	-	110,682,570	288,430	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	301,327,254	-	301,928,000	600,746	-	-	-	-
合計	1,458,716,508	-	1,456,590,962	7,537,778	-	-	-	-

## (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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	1.9583円	2.0905円
(1万口当たり純資産額)	(19,583円)	(20,905円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	900,000.000	621,648.000		
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	2,700,000.000	2,526,902.990		
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	4,779,692.820		
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	17,307,400.000	14,047,378.130		
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,597,829.000		
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	1,900,000.000	1,788,546.000		
	アメリカ・ドル 小計				26,361,996.940 (3,955,617,641)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	2,520,000.000	2,368,321.200		
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,890,272.000		
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	580,300.000		
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,376,630.800		
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	904,320.000		
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	974,000.000			
イギリス・ポンド 小計				10,093,844.000 (1,922,877,281)		
オーストラリア・ドル	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	8,900,000.000	9,190,407.000			
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,000,000.000	1,916,680.000			



	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	6,000,000.000	3,442,560.000	
オーストラリア・ドル 小計			14,549,647.000 (1,418,008,597)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,541,415.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	2,200,000.000	2,001,846.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	5,446,000.000	4,517,457.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	901,800.000	
カナダ・ドル 小計			8,962,518.000 (989,013,861)	
スウェーデン・ クローナ	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	8,230,000.000	7,882,694.000	
スウェーデン・クローナ 小計			7,882,694.000 (113,904,929)	
チェコ・コルナ	1% Czech Republic Government Bond 20260626	30,000,000.000	28,260,300.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	15,000,000.000	16,516,200.000	
チェコ・コルナ 小計			44,776,500.000 (287,626,325)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	6,936,325.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	19,853,166.000	
デンマーク・クローネ 小計			26,789,491.000 (585,082,484)	
ノルウェー・ク ローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	17,000,000.000	16,992,520.000	
ノルウェー・クローネ 小計			16,992,520.000 (241,123,859)	
ポーランド・ズ ロチ	2.25% Poland Government Bond 20241025	100,000.000	98,420.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	100,000.000	95,451.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,500,000.000	4,342,250.000	

		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	481,750.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	10,000,000.000	9,177,700.000	
ポーランド・ズロチ 小計				14,195,571.000 (535,979,335)	
ユーロ		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	100,000.000	99,805.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	500,000.000	402,315.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,108,184.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	600,000.000	586,920.000	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	7,400,000.000	6,581,486.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	8,623,104.960	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	2,600,000.000	1,842,802.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	450,000.000	307,633.500	
ユーロ 小計				20,552,250.460 (3,346,522,943)	
国債証券 合計				13,395,757,255 [13,395,757,255]	
特殊債券	オーストラリア・ドル	4.3% SWEDISH EXPORT CREDIT 20280530	800,000.000	790,968.000	
		1.25% INTL. FIN. CORP. 20310206	5,600,000.000	4,483,752.000	
		1.1% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20261216	2,500,000.000	2,290,275.000	
オーストラリア・ドル 小計				7,564,995.000 (737,284,413)	
カナダ・ドル		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	4,230,000.000	4,088,844.900	
		3.55% CANADA HOUSING TRUST 20320915	3,000,000.000	2,959,590.000	
		3.65% CANADA HOUSING TRUST 20330615	2,400,000.000	2,379,384.000	

カナダ・ドル 小計			9,427,818.900 (1,040,359,816)	
ユーロ	2.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20300730	3,500,000.000	3,501,785.000	
ユーロ 小計			3,501,785.000 (570,195,651)	
特殊債券 合計			2,347,839,880 [2,347,839,880]	
合計			15,743,597,135 [15,743,597,135]	

(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 6銘柄	100%	25.2%
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	100%	12.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	13.7%
	特殊債券 3銘柄		
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	100%	12.9%
	特殊債券 3銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	100%	0.7%
チェコ・コルナ	国債証券 2銘柄	100%	1.8%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	3.7%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	1.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 5銘柄	100%	3.4%
ユーロ	国債証券 8銘柄	100%	24.9%
	特殊債券 1銘柄		

## 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。

## 「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2023年9月6日現在 金額（円）	2024年3月6日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	262,442,358	170,814,877
国債証券	100,358,802,490	87,613,080,920
未収入金	-	415,164,000
未収利息	799,562,201	750,985,870
前払費用	30,610,402	1,076,711
流動資産合計	101,451,417,451	88,951,122,378
資産合計	101,451,417,451	88,951,122,378
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,717,820	74,211,460
流動負債合計	33,717,820	74,211,460
負債合計	33,717,820	74,211,460
純資産の部		
元本等		
元本	1 82,485,260,887	72,250,472,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,932,438,744	16,626,438,876
元本等合計	101,417,699,631	88,876,910,918
純資産合計	101,417,699,631	88,876,910,918
負債純資産合計	101,451,417,451	88,951,122,378

## 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9月7日 至2024年3月6日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	90,569,331,391円	82,485,260,887円
期中追加設定元本額	367,673,159円	577,013,690円
期中一部解約元本額	8,451,743,663円	10,811,802,535円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドV A （適格機関投資家専用）	40,632円	-円
安定重視ポートフォリオ（奇数 月分配型）	227,932,829円	260,532,474円
6 資産バランスファンド（分配 型）	207,849,397円	210,305,067円
6 資産バランスファンド（成長 型）	147,930,948円	160,972,112円
ダイワ日本国債ファンド（毎月 分配型）	76,283,328,572円	66,090,408,918円
世界6 資産均等分散ファンド （毎月分配型）	56,288,185円	56,288,185円
ダイワ日本国債ファンド（年1回 決算型）	5,489,581,465円	5,465,311,545円
目標利回り追求型債券ファンド	72,308,859円	6,653,741円
計	82,485,260,887円	72,250,472,042円
2. 期末日における受益権の総数	82,485,260,887口	72,250,472,042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9月7日 至2024年3月6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3月6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9月6日現在	2024年3月6日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	1,086,610,610	1,768,478,180
合計	1,086,610,610	1,768,478,180

(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9月6日現在	2024年3月6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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	1,2295円	1,2301円
(1万口当たり純資産額)	(12,295円)	(12,301円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	1 30年国債	2,250,000,000	2,548,867,500	
	12 30年国債	3,100,000,000	3,506,906,000	
	15 30年国債	1,100,000,000	1,290,003,000	
	16 30年国債	3,900,000,000	4,580,043,000	
	19 30年国債	1,200,000,000	1,389,936,000	
	20 30年国債	3,800,000,000	4,487,192,000	
	22 30年国債	1,500,000,000	1,776,045,000	
	24 30年国債	3,400,000,000	4,031,142,000	
	26 30年国債	2,000,000,000	2,350,000,000	
	27 30年国債	2,900,000,000	3,445,432,000	
	28 30年国債	2,600,000,000	3,089,502,000	
	29 30年国債	2,400,000,000	2,821,128,000	
	68 20年国債	3,125,000,000	3,127,593,750	
	70 20年国債	2,638,000,000	2,656,993,600	
	75 20年国債	3,374,000,000	3,446,304,820	
	80 20年国債	2,373,000,000	2,434,816,650	
	86 20年国債	3,400,000,000	3,546,540,000	
	88 20年国債	2,160,000,000	2,264,565,600	
94 20年国債	3,600,000,000	3,807,504,000		
95 20年国債	1,805,000,000	1,928,173,200		

101 20年国債	3,460,000,000	3,751,954,800	
106 20年国債	2,000,000,000	2,167,260,000	
110 20年国債	3,000,000,000	3,258,960,000	
116 20年国債	2,700,000,000	2,993,463,000	
121 20年国債	2,600,000,000	2,851,264,000	
125 20年国債	2,300,000,000	2,579,749,000	
130 20年国債	3,000,000,000	3,288,120,000	
134 20年国債	2,400,000,000	2,637,960,000	
140 20年国債	2,900,000,000	3,168,134,000	
143 20年国債	2,200,000,000	2,387,528,000	
国債証券 合計		87,613,080,920	
合計		87,613,080,920	

## 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9月6日現在 金額(円)	2024年3月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,045,387,930	254,934,891
コール・ローン	657,486,602	471,538,488
投資証券	90,573,263,065	94,706,977,720
派生商品評価勘定	43,092	25,348
未収入金	181,162,077	332,152,500
未収配当金	145,729,759	259,925,362
流動資産合計	92,603,072,525	96,025,554,309
資産合計	92,603,072,525	96,025,554,309
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,258	213,859



未払金		57,646,964	225,642,415
未払解約金		69,114,000	120,772,000
流動負債合計		126,811,222	346,628,274
負債合計		126,811,222	346,628,274
純資産の部			
元本等			
元本	1	24,494,736,083	23,059,444,312
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		67,981,525,220	72,619,481,723
元本等合計		92,476,261,303	95,678,926,035
純資産合計		92,476,261,303	95,678,926,035
負債純資産合計		92,603,072,525	96,025,554,309

## 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9月7日 至2024年3月6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	<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9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	25,508,106,430円	24,494,736,083円
期中追加設定元本額	852,291,901円	573,973,568円
期中一部解約元本額	1,865,662,248円	2,009,265,339円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
グローバルREIT・オープン	822,979円	818,519円
（適格機関投資家専用）		
ダイワ・グローバルREIT・	18,933,682,945円	17,497,535,886円
オープン（毎月分配型）		
ダイワ・バランス3資産（外	22,227,783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	10,482,112円	11,100,855円
月分配型）		
インカム重視ポートフォリオ	8,117,418円	7,126,660円
（奇数月分配型）		
成長重視ポートフォリオ（奇数	40,292,687円	39,713,028円
月分配型）		
6資産バランスファンド（分配	71,366,695円	63,036,626円
型）		

6 資産バランスファンド(成長型)	205,667,561円	195,072,506円
りそな ワールド・リート・ファンド	905,253,195円	854,866,124円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	19,430,802円	17,894,925円
常陽3分法ファンド	92,947,127円	84,444,544円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	22,716,838円	20,950,956円
ダイワ・グローバルREIT・オープン(為替ヘッジあり/毎月分配型)	40,885,327円	36,509,437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)	587,052,171円	689,713,135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)	829,166,523円	836,902,265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	1,834,720円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	369,686,908円	367,935,477円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	485,813,963円	491,672,057円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	772,789,435円	791,211,460円
グローバルREITファンド2021-07(適格機関投資家専用)	825,267,450円	819,148,875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)	207,708,483円	194,081,220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)	17,339,520円	14,079,757円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	26,018,161円	23,795,280円
計	24,494,736,083円	23,059,444,312円
2. 期末日における受益権の総数	24,494,736,083口	23,059,444,312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9月7日 至2024年3月6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	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3月6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9月6日現在	2024年3月6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	820,399,019	5,407,246,538
合計	820,399,019	5,407,246,538

(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9月6日現在				2024年3月6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)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	195,314,381	-	195,288,275	26,106	179,534,143	-	179,508,795	25,348
アメリカ・ドル	57,690,564	-	57,681,317	9,247	112,885,740	-	112,868,210	17,530
シンガポ ール・ドル	137,623,817	-	137,606,958	16,859	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	66,648,403	-	66,640,585	7,818
買建	195,314,381	-	195,281,109	33,272	179,534,143	-	179,320,284	213,859
アメリカ・ドル	137,623,817	-	137,640,803	16,986	66,648,403	-	66,621,375	27,028
イギリス ・ポンド	-	-	-	-	46,353,558	-	46,327,531	26,027
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	28,013,824	-	27,933,657	80,167
シンガポ ール・ドル	-	-	-	-	29,934,034	-	29,896,981	37,053
ニュージ ーランド・ドル	-	-	-	-	8,584,324	-	8,540,740	43,584

ユーロ	57,690,564	-	57,640,306	50,258	-	-	-	-
合計	390,628,762	-	390,569,384	7,166	359,068,286	-	358,829,079	188,511

(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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	3.7754円	4.1492円
(1万口当たり純資産額)	(37,754円)	(41,492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	179,907	26,960,863.020	
		EQUINIX INC	25,072	22,453,229.600	
		AMERICAN TOWER CORP	49,144	10,095,160.480	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	301,022	6,258,247.380	
		KIMCO REALTY CORP	355,159	6,989,529.120	

	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	588,714	7,988,848.980	
	INVITATION HOMES INC	688,027	23,991,501.490	
	AMERICOLD REALTY TRUST	279,314	7,262,164.000	
	VICI PROPERTIES INC	430,837	12,459,806.040	
	APARTMENT INCOME REIT CO	98,171	3,049,191.260	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	30,027	1,554,197.520	
	STAG INDUSTRIAL INC	46,322	1,719,472.640	
	DIGITAL CORE REIT UNITS	13,728,656	8,168,550.320	
	IRON MOUNTAIN INC	166,837	13,108,383.090	
	SUN COMMUNITIES INC	82,460	10,840,191.600	
	PROLOGIS INC	245,521	32,516,801.240	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	23,169	2,240,210.610	
	SITE CENTERS CORP	124,751	1,734,038.900	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	8,929	1,602,041.180	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	41,369	10,044,393.200	
	WELLTOWER INC	325,513	29,800,715.150	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	101,201	2,535,085.050	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,953	3,087,781.230	
	REALTY INCOME CORP	374,780	19,582,255.000	
	PUBLIC STORAGE	17,000	4,751,670.000	
	UDR INC	316,058	11,744,715.280	
	WP CAREY INC	121,414	6,893,886.920	
	AGREE REALTY CORP	47,169	2,693,821.590	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	161,974	24,336,593.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	92,834	13,236,271.720	
	アメリカ・ドル 小計		329,699,617.110 (49,471,427,547)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,439,524	8,870,346.880	
	SEGRO PLC	1,788,425	15,519,952.150	
	UNITE GROUP PLC/THE	552,471	5,284,385.110	
	DERWENT LONDON PLC	16,339	331,354.920	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	533,429	4,064,728.980	
	BIG YELLOW GROUP PLC	374,476	3,883,316.120	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	3,965,237	7,367,410.340	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,473,578	8,117,316.170	
	イギリス・ポンド 小計		53,438,810.670 (10,180,093,432)	

オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	5,181,504	11,762,014.080	
	GPT GROUP	3,351,907	14,312,642.890	
	MIRVAC GROUP	6,712,188	14,431,204.200	
	STOCKLAND	4,184,235	19,289,323.350	
	GOODMAN GROUP	2,329,040	72,200,240.000	
	CHARTER HALL GROUP	1,339,015	17,032,270.800	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,461,935	17,067,339.550	
オーストラリア・ドル 小計			166,095,034.870 (16,187,622,098)	
カナダ・ドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	651,951	8,279,777.700	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	261,814	4,136,661.200	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	154,920	11,856,027.600	
カナダ・ドル 小計			24,272,466.500 (2,678,466,679)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,051,400	15,297,660.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	6,334,600	9,185,170.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	4,339,000	9,328,850.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,822,877	16,783,611.960	
シンガポール・ドル 小計			50,595,291.960 (5,652,000,065)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,195,309	9,229,679.800	
ニュージーランド・ドル 小計			9,229,679.800 (841,193,017)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	68,627	1,343,030.390	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	153,223	10,584,644.840	
	GECINA SA	47,105	4,126,398.000	
	KLEPIERRE	354,594	8,318,775.240	
	MERCIALYS	180,896	1,821,622.720	
	AEDIFICA	104,002	5,444,504.700	
	COFINIMMO	39,194	2,206,622.200	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	253,897	6,256,022.080	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	27,413	686,695.650	
	MONTEA NV	28,056	2,109,811.200	



	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	609,489	5,381,787.870	
ユーロ 小計			48,279,914.890 (7,861,418,541)	
香港・ドル	LINK REIT	2,610,092	95,659,871.800	
香港・ドル 小計			95,659,871.800 (1,834,756,341)	
投資証券 合計			94,706,977,720 [94,706,977,720]	
合計			94,706,977,720 [94,706,977,720]	

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%	52.3%
イギリス・ポンド	投資証券 8銘柄	100%	10.7%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	17.1%
カナダ・ドル	投資証券 3銘柄	100%	2.8%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	6.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.9%
ユーロ	投資証券 11銘柄	100%	8.3%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.9%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2023年9月6日現在 金額（円）	2024年3月6日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,785,456,340	2,152,515,773
投資証券	2 163,340,693,700	162,972,352,250
派生商品評価勘定	26,281,440	37,860
未収入金	526,745,063	1,028,005,803
未収配当金	2,296,129,171	2,704,848,979
前払金	-	78,444,450
流動資産合計	169,975,305,714	168,936,205,115
資産合計	169,975,305,714	168,936,205,115
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	60,862,530
前受金	38,251,000	-
未払金	628,856,366	598,345,825
未払解約金	5,763,000	38,600,000
流動負債合計	672,870,366	697,808,355
負債合計	672,870,366	697,808,355
純資産の部		
元本等		
元本	1 47,289,559,867	51,211,609,118
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	122,012,875,481	117,026,787,642
元本等合計	169,302,435,348	168,238,396,760
純資産合計	169,302,435,348	168,238,396,760
負債純資産合計	169,975,305,714	168,936,205,115

## 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9月7日 至2024年3月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<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9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	41,048,417,431円	47,289,559,867円
期中追加設定元本額	6,323,321,872円	4,898,028,586円
期中一部解約元本額	82,179,436円	975,979,335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)	44,146,208,889円	47,888,632,587円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	11,179,771円	13,523,527円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,632,593円	8,936,176円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	42,948,356円	47,912,927円
6資産バランスファンド(分配型)	75,286,260円	74,993,956円
6資産バランスファンド(成長型)	217,513,108円	234,401,723円

	世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	20,845,419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)	24,511,553円	25,448,715円
	DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	392,423,335円	440,904,679円
	DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	514,795,008円	581,994,599円
	DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	818,127,151円	937,133,047円
	DCダイワJ-REITアク ティブファンド	239,595,173円	216,274,714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)	55,354,600円	58,978,414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)	18,321,188円	19,609,352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	100,097,769円
	ダイワ・アクティブJリート・ ファンド(年4回決算型)	612,829,430円	542,500,130円
	計	47,289,559,867円	51,211,609,118円
2.	期末日における受益権の総数	47,289,559,867口	51,211,609,118口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 1,052,900,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 1,109,000,000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9月7日 至2024年3月6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）における不動産投信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	<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3月6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9月6日現在	2024年3月6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	3,363,812,446	9,974,767,325
合計	3,363,812,446	9,974,767,325

(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9月6日現在				2024年3月6日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	3,388,175,000	-	3,414,654,000	26,479,000	3,219,336,850	-	3,158,717,000	60,619,850
合計	3,388,175,000	-	3,414,654,000	26,479,000	3,219,336,850	-	3,158,717,000	60,619,850

(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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	3.5801円	3.2852円
(1万口当たり純資産額)	(35,801円)	(32,852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	6,366	548,749,200	
	SOSILA物流リート投	8,709	1,008,502,200	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	10,748	6,233,840,000	
	森ヒルズリート	18,616	2,433,111,200	
	産業ファンド	22,392	2,884,089,600	
	アドバンス・レジデンス	16,020	4,974,210,000	
	A P I 投資法人	4,757	1,807,660,000	
	G L P 投資法人	81,605	9,931,328,500	
	コンフォリア・レジデンシャル	10,597	3,090,085,200	
	日本プロロジスリート	44,264	11,088,132,000	
	星野リゾート・リート	2,791	1,585,288,000	
	O n e リート投資法人	2,735	696,331,000	
	イオンリート投資	29,111	3,886,318,500	
	ヒューリックリート投資法	20,928	3,019,910,400	
	日本リート投資法人	9,463	3,118,058,500	
	積水ハウス・リート投資	23,105	1,709,770,000	
	トーセイ・リート投資法人	1,019	140,622,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,596	728,039,600	
	野村不動産マスターF	43,318	6,142,492,400	
	ラサールロジポート投資	21,877	3,218,106,700	
	三井不ロジパーク	3,154	1,390,914,000	
	投資法人みらい	10,003	439,631,850	
	三菱地所物流REIT	13,680	5,034,240,000	
	CREロジスティクスファンド	15,127	2,173,749,900	
	ザイマックス・リート	5,869	672,587,400	
	タカラレーベン不動産投	170	16,456,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法 人	1,864	224,239,200	
	日本ビルファンド	19,711	11,333,825,000	
	ジャパンリアルエステイト	13,022	6,953,748,000	
	日本都市ファンド投資法人	94,385	8,532,404,000	
	オリックス不動産投資	38,134	5,891,703,000	
日本プライムリアルティ	14,854	4,775,561,000		
NTT都市開発リート投資法人	19,937	2,358,547,100		
東急リアル・エステート	4,859	791,045,200		

グローバル・ワン不動産投資法人	2,052	219,974,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	32,763	4,632,688,200	
インヴィンシブル投資法人	61,622	3,857,537,200	
フロンティア不動産投資	4,120	1,767,480,000	
平和不動産リート	2,674	358,850,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,234	1,378,635,600	
KDX不動産投資法人	60,815	8,860,745,500	
いちごオフィスリート投資法人	21,945	1,724,877,000	
大和証券オフィス投資法人	3,360	1,938,720,000	
阪急阪神リート投資法人	4,892	666,779,600	
スタートプロシード投資法人	1,712	334,524,800	
大和ハウスリート投資法人	35,720	8,915,712,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	95,733	7,179,975,000	
大和証券リビング投資法人	22,911	2,302,555,500	
投資証券 合計		162,972,352,250	
合計		162,972,352,250	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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。

「ダイワ日本ハーモニースtock・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9月6日現在 金額(円)	2024年3月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		



コール・ローン	17,834,670	8,226,990
株式	1,361,874,150	1,378,334,660
未収配当金	348,000	743,500
流動資産合計	1,380,056,820	1,387,305,150
資産合計	1,380,056,820	1,387,305,150
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	5,000,000
流動負債合計	-	5,000,000
負債合計	-	5,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 693,363,198	580,267,403
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	686,693,622	802,037,747
元本等合計	1,380,056,820	1,382,305,150
純資産合計	1,380,056,820	1,382,305,150
負債純資産合計	1,380,056,820	1,387,305,150

## 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9月7日 至2024年3月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	789,664,444円	693,363,198円
期中追加設定元本額	- 円	536,337円
期中一部解約元本額	96,301,246円	113,632,132円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6 資産バランスファンド（分配型）	144,174,558円	112,202,555円
6 資産バランスファンド（成長型）	509,453,834円	433,765,235円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	39,734,806円	34,299,613円
計	693,363,198円	580,267,403円
2. 期末日における受益権の総数	693,363,198口	580,267,403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9月7日 至2024年3月6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3月6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9月6日現在	2024年3月6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	240,513,496	231,099,882
合計	240,513,496	231,099,882

(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9月6日現在	2024年3月6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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	1.9904円	2.3822円
(1万口当たり純資産額)	(19,904円)	(23,822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	
大和ハウス	6,800	4,345.00	29,546,000	
味の素	7,600	5,553.00	42,202,800	
日産化学	2,600	6,106.00	15,875,600	

イビデン	2,400	7,194.00	17,265,600	
信越化学	7,300	6,585.00	48,070,500	
日本酸素HLDGS	6,600	4,894.00	32,300,400	
野村総合研究所	9,800	4,394.00	43,061,200	
テルモ	5,200	5,816.00	30,243,200	
第一三共	8,800	4,930.00	43,384,000	
オリエンタルランド	7,400	5,209.00	38,546,600	
富士フイルムHLDGS	1,600	9,937.00	15,899,200	
住友電工	17,700	2,263.00	40,055,100	
リクルートホールディングス	7,900	6,207.00	49,035,300	
ディスコ	1,200	52,350.00	62,820,000	
S M C	300	90,980.00	27,294,000	
ダイキン工業	1,600	21,150.00	33,840,000	
日立	5,800	13,080.00	75,864,000	
ソニーグループ	5,500	12,955.00	71,252,500	
アドバンテスト	1,500	7,301.00	10,951,500	
キーエンス	700	74,100.00	51,870,000	
デンソー	8,600	2,855.00	24,553,000	
村田製作所	9,200	2,965.00	27,278,000	
トヨタ自動車	19,600	3,769.00	73,872,400	
HOYA	1,000	19,600.00	19,600,000	
バンダイナムコHLDGS	4,300	2,915.50	12,536,650	
アシックス	9,300	6,700.00	62,310,000	
任天堂	7,900	8,329.00	65,799,100	
東京エレクトロン	1,900	39,600.00	75,240,000	
ユニ・チャーム	6,100	4,896.00	29,865,600	
三菱UFJフィナンシャルG	27,100	1,608.00	43,576,800	
三井住友フィナンシャルG	3,600	8,773.00	31,582,800	
東京海上HD	7,200	4,415.00	31,788,000	
三井不動産	5,000	4,275.00	21,375,000	
日本電信電話	196,100	182.10	35,709,810	
ファーストリテイリング	1,000	43,870.00	43,870,000	
合計			1,378,334,660	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「ダイワ外国ハーモニーストック・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9月6日現在 金額(円)	2024年3月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	-	6,011,367
コール・ローン	755,246	348,853
株式	1,343,316,948	1,344,071,502
派生商品評価勘定	-	5,351
未収入金	68,008,953	-
未収配当金	1,589,601	1,230,037
流動資産合計	1,413,670,748	1,351,667,110
資産合計	1,413,670,748	1,351,667,110
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,292	-
前受金	64,288,899	-
未払解約金	-	4,000,000
流動負債合計	64,293,191	4,000,000
負債合計	64,293,191	4,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 292,224,192	243,685,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,057,153,365	1,103,981,956
元本等合計	1,349,377,557	1,347,667,110
純資産合計	1,349,377,557	1,347,667,110
負債純資産合計	1,413,670,748	1,351,667,110

## 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9月7日 至2024年3月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金  原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首	2023年3月7日	2023年9月7日
期首元本額	328,472,263円	292,224,192円
期中追加設定元本額	278,575円	4,393,782円
期中一部解約元本額	36,526,646円	52,932,820円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6 資産バランスファンド（分配型）	61,603,428円	47,057,993円
6 資産バランスファンド（成長型）	214,072,686円	181,973,221円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	16,548,078円	14,653,940円
計	292,224,192円	243,685,154円
2. 期末日における受益権の総数	292,224,192口	243,685,154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9月7日 至2024年3月6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まいります。</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3月6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9月6日現在	2024年3月6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	165,063,498	227,766,716
合計	165,063,498	227,766,716

(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9月6日現在				2024年3月6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	3,000,000	-	3,004,292	4,292	4,000,000	-	3,994,649	5,351
アメリカ・ドル	3,000,000	-	3,004,292	4,292	4,000,000	-	3,994,649	5,351
合計	3,000,000	-	3,004,292	4,292	4,000,000	-	3,994,649	5,351

(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9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4,6176円 (46,176円)	5,5304円 (55,304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	255	118.480	30,212.400	
	ADOBE INC	140	544.840	76,277.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	40	239.580	9,583.200	
	DR HORTON INC	250	151.120	37,780.000	
	MOODY'S CORP	40	382.500	15,300.000	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	75	244.000	18,300.000	
	HESS CORP	95	146.360	13,904.200	
	DANAHER CORP	125	254.390	31,798.750	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	150	139.420	20,913.000	
	APPLE INC	2,900	170.120	493,348.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	285	40.350	11,499.750	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	270	400.740	108,199.800	
	JPMORGAN CHASE & CO	810	188.550	152,725.500	
	CADENCE DESIGN SYS INC	250	307.700	76,925.000	
	SERVICENOW INC	118	740.150	87,337.700	
	CATERPILLAR INC	225	333.530	75,044.250	
	CISCO SYSTEMS INC	100	48.950	4,895.000	
	MORGAN STANLEY	90	89.130	8,021.700	
	MSCI INC	25	550.350	13,758.750	
	BROADCOM INC	130	1,342.750	174,557.500	
	DEERE & CO	20	366.730	7,334.600	
	QUANTA SERVICES INC	200	239.710	47,942.000	
	AMETEK INC	240	179.450	43,068.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	127	759.950	96,513.650	
	T-MOBILE US INC	265	165.900	43,963.500	
	COCA-COLA CO/THE	630	59.520	37,497.600	
	AMAZON.COM INC	2,300	174.120	400,476.000	
EXXON MOBIL CORP	575	105.640	60,743.000		

NEXTERA ENERGY INC	150	55.400	8,310.000
UNITED RENTALS INC	75	679.370	50,952.750
FISERV INC	285	149.950	42,735.750
GENERAL ELECTRIC CO	200	157.860	31,572.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	80	390.910	31,272.800
ALPHABET INC-CL C	2,350	133.780	314,383.000
HOME DEPOT INC	250	378.450	94,612.500
HUBBELL INC	125	380.650	47,581.250
ZOETIS INC	150	185.230	27,784.500
TRANE TECHNOLOGIES PLC	240	284.060	68,174.400
JOHNSON & JOHNSON	380	159.970	60,788.600
ABBVIE INC	455	179.160	81,517.800
KLA CORP	120	705.870	84,704.400
LOWE'S COS INC	185	240.820	44,551.700
ELI LILLY & CO	270	777.590	209,949.300
LAM RESEARCH CORP	75	963.100	72,232.500
MCDONALD'S CORP	175	292.540	51,194.500
META PLATFORMS INC CLASS A	750	490.220	367,665.000
S&P GLOBAL INC	100	422.310	42,231.000
MARVELL TECHNOLOGY INC	175	78.730	13,777.750
ROCKWELL AUTOMATION INC	20	287.680	5,753.600
MERCK & CO. INC.	700	122.830	85,981.000
MARSH & MCLENNAN COS	250	201.900	50,475.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	210	247.880	52,054.800
NIKE INC -CL B	190	98.310	18,678.900
KKR & CO INC	950	96.610	91,779.500
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	45	1,079.670	48,585.150
PFIZER INC	275	26.080	7,172.000
CIGNA CORP	50	332.730	16,636.500
STRYKER CORP	180	352.390	63,430.200
PROCTER & GAMBLE CO/THE	610	159.320	97,185.200
CONOCOPHILLIPS	320	111.220	35,590.400
PEPSICO INC	150	162.040	24,306.000
ACCENTURE PLC-CL A	75	376.880	28,266.000
QUALCOMM INC	430	161.450	69,423.500
REGENERON PHARMACEUTICALS	20	965.210	19,304.200
REPUBLIC SERVICES INC	75	183.760	13,782.000
BOOKING HOLDINGS INC	3	3,430.250	10,290.750
ROSS STORES INC	100	149.170	14,917.000

CHEVRON CORP	205	149.590	30,665.950	
TESLA INC	425	180.740	76,814.500	
SYNOPSYS INC	134	565.260	75,744.840	
AT&T INC	200	17.170	3,434.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	40	170.640	6,825.600	
SALESFORCE.COM INC	420	298.750	125,475.000	
UNION PACIFIC CORP	15	253.700	3,805.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	230	473.150	108,824.500	
ELEVANCE HEALTH INC	15	498.350	7,475.250	
WALT DISNEY CO/THE	195	112.870	22,009.650	
WELLS FARGO & CO	645	56.600	36,507.000	
WASTE MANAGEMENT INC	290	206.870	59,992.300	
TJX COMPANIES INC	585	97.390	56,973.150	
VISA INC-CLASS A SHARES	425	279.380	118,736.500	
NVIDIA CORP	800	859.640	687,712.000	
NETFLIX INC	100	598.500	59,850.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	67	584.610	39,168.870	
ORACLE CORP	450	110.940	49,923.000	
MASTERCARD INC - A	240	467.520	112,204.800	
YUM! BRANDS INC	150	138.700	20,805.000	
BANK OF AMERICA CORP	1,350	35.390	47,776.500	
AMERICAN EXPRESS CO	385	217.200	83,622.000	
LINDE PLC	175	460.960	80,668.000	
ANALOG DEVICES INC	125	189.800	23,725.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	350	205.130	71,795.500	
EMERSON ELECTRIC CO	345	109.020	37,611.900	
AON PLC-CLASS A	35	315.200	11,032.000	
AMGEN INC	50	276.650	13,832.500	
EATON CORP PLC	355	291.930	103,635.150	
APPLIED MATERIALS INC	465	207.390	96,436.350	
CME GROUP INC	125	219.900	27,487.500	
GILEAD SCIENCES INC	100	72.990	7,299.000	
INTEL CORP	425	43.160	18,343.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	25	387.320	9,683.000	
WW GRAINGER INC	40	985.760	39,430.400	
CINTAS CORP	80	625.390	50,031.200	
MICROSOFT CORP	1,570	402.650	632,160.500	
MICRON TECHNOLOGY INC	925	94.470	87,384.750	
BLACKROCK INC	65	826.940	53,751.100	

	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	225	70.840	15,939.000	
	CHUBB LTD	200	249.360	49,872.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	45	147.320	6,629.400	
	PROGRESSIVE CORP	50	189.810	9,490.500	
	PVH CORP	300	138.010	41,403.000	
	STARBUCKS CORP	75	91.220	6,841.500	
	INTUIT INC	111	639.730	71,010.030	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	875	67.020	58,642.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	140	415.440	58,161.600	
	COMCAST CORP-CLASS A	175	42.060	7,360.500	
アメリカ・ドル 小計				8,221,526.440 (1,233,640,042)	
イギリス・ポンド	BHP GROUP PLC	325	22.745	7,392.120	
	BP PLC	600	4.709	2,825.400	
	DIAGEO PLC	150	29.230	4,384.500	
	ASTRAZENECA PLC	250	101.120	25,280.000	
イギリス・ポンド 小計				39,882.020 (7,597,525)	
スイス・フラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	30	234.700	7,041.000	
	ABB LTD-REG	1,050	40.380	42,399.000	
	NESTLE SA-REG	300	91.930	27,579.000	
	NOVARTIS AG-REG	285	90.540	25,803.900	
スイス・フラン 小計				102,822.900 (17,442,877)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	1,175	855.000	1,004,625.000	
デンマーク・クローネ 小計				1,004,625.000 (21,941,010)	
ユーロ	SIEMENS AG-REG	350	178.540	62,489.000	
	SAP SE	25	173.480	4,337.000	
	AIXTRON SE	300	27.910	8,373.000	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	200	33.160	6,632.000	
	ASML HOLDING NV	134	899.500	120,533.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	300	207.950	62,385.000	
	L'OREAL	90	438.350	39,451.500	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	85	829.100	70,473.500	
	STMICROELECTRONICS NV	100	42.415	4,241.500	
	IBERDROLA SA	1,000	10.755	10,755.000	

ユーロ 小計			389,670.500 (63,450,048)	
合計			1,344,071,502 [1,344,071,502]	

## (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
アメリカ・ドル	株式 116銘柄	100%	91.8%
イギリス・ポンド	株式 4銘柄	100%	0.6%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	1.3%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.6%
ユーロ	株式 10銘柄	100%	4.7%

## 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。

## 【6 資産バランスファンド（成長型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期計算期間(2023年9月7日から2024年3月6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】

## 6 資産バランスファンド（成長型）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第35期 2023年9月6日現在	第36期 2024年3月6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	244,217,052	371,542,722
親投資信託受益証券	3,932,352,919	4,016,993,460
未収入金	-	11,000,000
流動資産合計	4,176,569,971	4,399,536,182
資産合計	4,176,569,971	4,399,536,182
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	182,622,437	305,435,252
未払解約金	471,243	11,594,659
未払受託者報酬	1,067,837	1,112,861
未払委託者報酬	27,765,097	28,935,326
その他未払費用	160,086	166,851
流動負債合計	212,086,700	347,244,949
負債合計	212,086,700	347,244,949
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,043,707,288	1 3,054,352,527
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	920,775,983	997,938,706
（分配準備積立金）	623,008,236	669,506,703
元本等合計	3,964,483,271	4,052,291,233
純資産合計	3,964,483,271	4,052,291,233
負債純資産合計	4,176,569,971	4,399,536,182



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第35期 自 2023年3月7日 至 2023年9月6日	第36期 自 2023年9月7日 至 2024年3月6日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3	-
有価証券売買等損益	511,545,139	413,640,541
<b>営業収益合計</b>	<b>511,545,142</b>	<b>413,640,541</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	10,930	4,386
受託者報酬	1,067,837	1,112,861
委託者報酬	<sup>1</sup> 27,765,097	<sup>1</sup> 28,935,326
その他費用	160,086	166,851
<b>営業費用合計</b>	<b>29,003,950</b>	<b>30,219,424</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>482,541,192</b>	<b>383,421,117</b>
経常利益又は経常損失（ ）	482,541,192	383,421,117
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>482,541,192</b>	<b>383,421,117</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	4,851,086	5,619,262
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>626,674,327</b>	<b>920,775,983</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,920,338	44,426,390
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>14,920,338</b>	<b>44,426,390</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,886,351	39,630,270
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>15,886,351</b>	<b>39,630,270</b>
分配金	<sup>2</sup> 182,622,437	<sup>2</sup> 305,435,252
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>920,775,983</b>	<b>997,938,706</b>

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第36期
	自2023年9月7日 至2024年3月6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35期	第36期
	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1. 1 期首元本額	3,058,831,402円	3,043,707,288円
期中追加設定元本額	62,370,138円	141,691,191円
期中一部解約元本額	77,494,252円	131,045,952円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	3,043,707,288口	3,054,352,527口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第35期	第36期
	自2023年3月7日 至2023年9月6日	自2023年9月7日 至2024年3月6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	1,870,223円	2,026,708円

<p>2. 2 分配金の計算過程</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(47,266,636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(216,733,119円)、投資信託約款に規定される収益調整金(357,526,760円)及び分配準備積立金(541,630,918円)より分配対象額は1,163,157,433円(1万口当たり3,821.52円)であり、うち182,622,437円(1万口当たり600円)を分配金額としております。</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(44,210,066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(333,591,789円)、投資信託約款に規定される収益調整金(387,131,205円)及び分配準備積立金(597,140,100円)より分配対象額は1,362,073,160円(1万口当たり4,459.45円)であり、うち305,435,252円(1万口当たり1,000円)を分配金額としております。</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36期 自2023年9月7日 至2024年3月6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36期
	2024年3月6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35期	第36期
	2023年9月6日現在	2024年3月6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	473,844,051	356,574,055
合計	473,844,051	356,574,055

## (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35期	第36期
2023年9月6日現在	2024年3月6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36期
自2023年9月7日 至2024年3月6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35期	第36期
	2023年9月6日現在	2024年3月6日現在
1口当たり純資産額	1.3025円	1.3267円
(1万口当たり純資産額)	(13,025円)	(13,267円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	95,589,592	199,830,042	
	ダイワ日本国債マザーファンド	160,972,112	198,011,794	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	195,072,506	809,394,841	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	234,401,723	770,056,540	
	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	433,765,235	1,033,315,542	
	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	181,973,221	1,006,384,701	
親投資信託受益証券 合計			4,016,993,460	
合計			4,016,993,460	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ外国ハーモニースtock・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。

#### 「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」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「6 資産バランスファンド(分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド」の状況

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド」の状況

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」に記載のとおりであります。



## 2【ファンドの現況】

## 6 資産バランスファンド(分配型)

## 【純資産額計算書】

2024年3月29日

資産総額	2,707,544,657円
負債総額	2,367,157円
純資産総額( - )	2,705,177,500円
発行済数量	2,565,055,903口
1単位当たり純資産額( / )	1.0546円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	16,367,503,231円
負債総額	3,817,166円
純資産総額( - )	16,363,686,065円
発行済数量	7,758,884,407口
1単位当たり純資産額( / )	2.1090円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	87,959,238,841円
負債総額	28,746,087円
純資産総額( - )	87,930,492,754円
発行済数量	71,509,521,220口
1単位当たり純資産額( / )	1.2296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3月29日

資産総額	99,016,278,865円
負債総額	138,697,240円
純資産総額( - )	98,877,581,625円
発行済数量	22,920,922,001口
1単位当たり純資産額( / )	4.3139円

## (参考) ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	171,305,488,459円
負債総額	803,957,868円
純資産総額( - )	170,501,530,591円
発行済数量	49,127,566,849口
1単位当たり純資産額( / )	3.4706円

## (参考) ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	1,440,449,248円
負債総額	40円
純資産総額( - )	1,440,449,208円
発行済数量	250,287,549口
1単位当たり純資産額( / )	5.7552円

## (参考) ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	1,417,640,514円
負債総額	0円
純資産総額( - )	1,417,640,514円

発行済数量	587,584,943口
1単位当たり純資産額( / )	2.4127円

### 6 資産バランスファンド(成長型)

#### 純資産額計算書

2024年3月29日

資産総額	4,357,824,372円
負債総額	4,860,144円
純資産総額( - )	4,352,964,228円
発行済数量	3,178,699,222口
1単位当たり純資産額( / )	1.3694円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド(分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

前記「6 資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2024年3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3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	291,304
追加型株式投資信託	798	29,461,519
株式投資信託 合計	885	29,752,823
単位型公社債投資信託	98	178,379
追加型公社債投資信託	14	1,544,340
公社債投資信託 合計	112	1,722,719
総合計	997	31,475,542

## 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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
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	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	(注3)	
投資顧問会社	コーヘン&ステイアーズ・ 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ないます。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。



## 第3【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2023年9月21日	臨時報告書
2023年11月29日	有価証券報告書、有価証券届出書
2023年12月20日	臨時報告書

**独立監査人の監査報告書**

2023年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。



財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2024年4月19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6資産バランスファンド（分配型）の2023年9月7日から2024年3月6日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、6資産バランスファンド（分配型）の2024年3月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、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4月19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6資産バランスファンド（成長型）の2023年9月7日から2024年3月6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、6資産バランスファンド（成長型）の2024年3月6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を検討すること、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。