

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2024年9月3日提出
【計算期間】	第1計算期間中 (自 2023年12月11日 至 2024年6月10日)
【ファンド名】	スタイル9(4資産分散・保守型) スタイル9(4資産分散・バランス型) スタイル9(4資産分散・積極型) スタイル9(6資産分散・保守型) スタイル9(6資産分散・バランス型) スタイル9(6資産分散・積極型) スタイル9(8資産分散・保守型) スタイル9(8資産分散・バランス型) スタイル9(8資産分散・積極型)
【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。

1 【ファンドの運用状況】

【スタイル9(4資産分散・保守型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,976,507	98.70
内 日本	4,976,507	98.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	65,608	1.30
純資産総額	5,042,115	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) 【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)
2023年12月末日	1,020,303	-	1.0180	-
2024年1月末日	1,315,652	-	1.0370	-
2月末日	1,853,199	-	1.0551	-
3月末日	2,400,929	-	1.0696	-
4月末日	3,172,352	-	1.0643	-
5月末日	4,141,755	-	1.0601	-
6月末日	5,042,115	-	1.0774	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	6.7

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	356,848,098,460	97.29
内 日本	356,848,098,460	97.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,948,700,240	2.71
純資産総額	366,796,798,700	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	10,033,485,000	2.74
内 日本	10,033,485,000	2.74

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

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	102,425,922,310	83.30
内 日本	102,425,922,310	83.30
地方債証券	6,955,119,500	5.66
内 日本	6,955,119,500	5.66
特殊債券	3,930,696,700	3.20
内 日本	3,930,696,700	3.20
社債券	8,922,670,200	7.26
内 日本	8,922,670,200	7.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	720,559,638	0.59
純資産総額	122,954,968,348	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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2024年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	562,775,261,383	93.29
内 香港	2,744,766,073	0.45
内 シンガポール	2,063,951,679	0.34
内 イスラエル	1,174,889,728	0.19
内 ノルウェー	952,444,311	0.16
内 スウェーデン	5,170,455,653	0.86
内 デンマーク	6,406,549,059	1.06
内 イギリス	22,013,524,127	3.65
内 アイルランド	513,921,897	0.09
内 オランダ	7,998,096,313	1.33
内 ベルギー	1,376,174,264	0.23
内 フランス	16,509,235,029	2.74
内 ドイツ	12,726,658,167	2.11
内 スイス	13,789,344,890	2.29
内 ポルトガル	283,387,288	0.05
内 スペイン	3,945,241,715	0.65
内 イタリア	3,965,554,321	0.66
内 フィンランド	1,493,680,183	0.25
内 オーストリア	271,660,416	0.05
内 カナダ	16,421,976,863	2.72
内 アメリカ	433,018,528,390	71.78
内 オーストラリア	9,651,145,005	1.60
内 ニューージーランド	284,076,012	0.05
投資証券	10,781,021,273	1.79
内 香港	137,104,917	0.02
内 シンガポール	143,365,257	0.02
内 イギリス	178,822,540	0.03
内 ベルギー	42,780,757	0.01
内 フランス	191,502,653	0.03
内 カナダ	37,829,671	0.01

	内 アメリカ	9,125,518,640	1.51
	内 オーストラリア	924,096,838	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		29,697,518,808	4.92
純資産総額		603,253,801,464	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	29,667,251,277	4.92
内 イギリス	1,538,797,152	0.26
内 ドイツ	5,384,987,995	0.89
内 カナダ	2,225,325,053	0.37
内 アメリカ	19,295,155,152	3.20
内 オーストラリア	1,222,985,925	0.20
為替予約取引(買建)	13,964,270,370	2.31
内 日本	13,964,270,370	2.31

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

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

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

(注4) 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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	322,115,558,413	97.53
内 ユーロ	99,936,688,690	30.26
内 中国	31,320,232,741	9.48
内 シンガポール	1,272,849,614	0.39
内 マレーシア	1,609,975,117	0.49
内 イスラエル	979,474,671	0.30
内 ノルウェー	488,541,383	0.15
内 スウェーデン	477,706,431	0.14
内 デンマーク	819,447,889	0.25
内 イギリス	16,805,184,567	5.09

内 ポーランド	1,671,802,019	0.51
内 カナダ	6,366,744,462	1.93
内 アメリカ	153,279,093,268	46.41
内 メキシコ	2,279,205,061	0.69
内 オーストラリア	4,076,235,844	1.23
内 ニュージーランド	732,376,656	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,143,333,654	2.47
純資産総額	330,258,892,067	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,487,361,743	0.75
内 日本	2,487,361,743	0.75

(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。

(参考情報) 運用実績

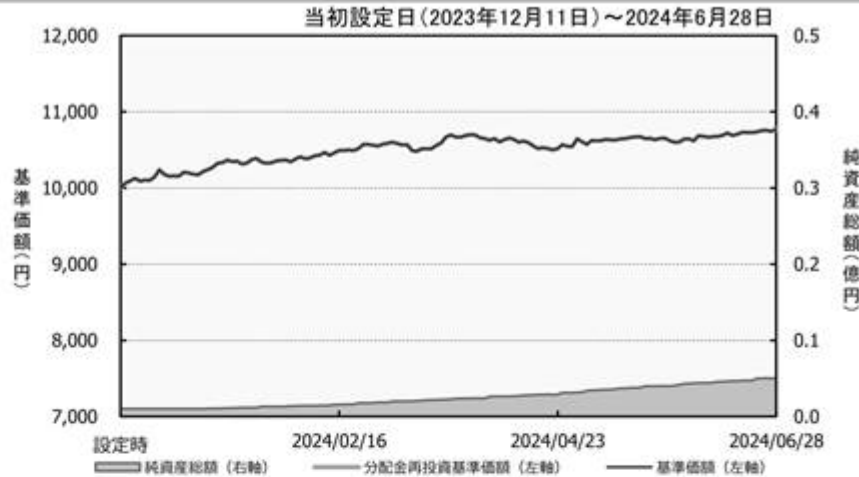
●スタイル9(4資産分散・保守型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,774円
純資産総額	5百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	0.7%
6カ月間	5.8%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	7.7%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/03/31	0円
2024/06/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

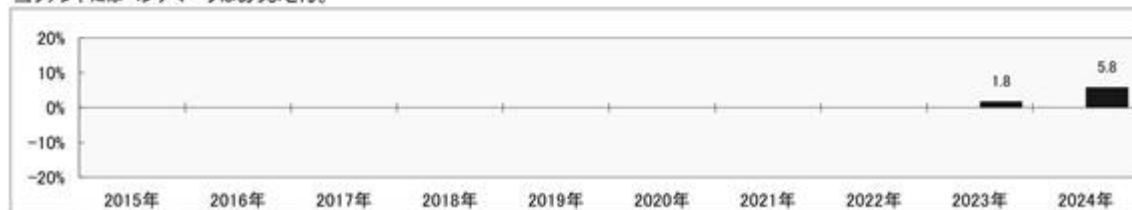
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.0%	国内債券	424	58.6%	日本円	74.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%
外国株式INDEXMF	18.6%	外国株式・先物	1,178	18.3%	米ドル	17.5%	APPLE INC	アメリカ	0.9%
トピックス・インデックス・MF	14.3%	国内株式・先物	2,120	14.3%	ユーロ	3.7%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
外国債券INDEXMF	6.9%	外国債券	1,003	6.7%	英ポンド	1.1%	トヨタ自動車	日本	0.6%
		外国リート	53	0.3%	カナダ・ドル	0.7%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	0.6%
		外国投資証券	3	0.0%	オフショア人民元	0.7%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.5%
					スイス・フラン	0.5%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.4%
					豪ドル	0.5%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
					デンマーク・クローネ	0.2%	ソニーグループ	日本	0.3%
		コール・ローン、その他		3.1%	その他	0.6%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.3%
合計	98.7%	合計	4,781	-	合計	100.0%	合計		5.8%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(4資産分散・バランス型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券	25,414,363	98.69
内 日本	25,414,363	98.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	337,354	1.31
純資産総額	25,751,717	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) 【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)
2023年12月末日	1,025,481	-	1.0232	-
2024年1月末日	3,572,858	-	1.0619	-
2月末日	6,907,289	-	1.0918	-
3月末日	11,159,015	-	1.1193	-
4月末日	15,457,984	-	1.1210	-
5月末日	20,929,351	-	1.1275	-
6月末日	25,751,717	-	1.1590	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	13.7

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●スタイル9(4資産分散・バランス型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,590円
純資産総額	25百万円



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/03/31	0円
2024/06/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

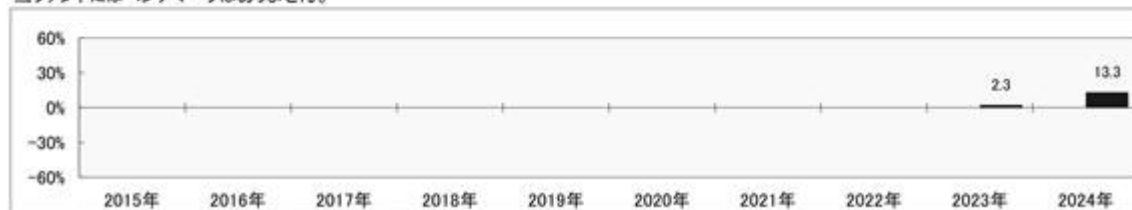
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	30.5%	外国株式・先物	1,178	30.0%	日本円	51.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
日本債券INDEXMF	26.9%	国内債券	424	26.7%	米ドル	31.9%	APPLE INC	アメリカ	1.5%
トピックス・インデックス・MF	23.4%	国内株式・先物	2,120	23.4%	ユーロ	8.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.4%
外国債券INDEXMF	17.9%	外国債券	1,003	17.4%	英ポンド	2.1%	トヨタ自動車	日本	1.0%
		外国リート	53	0.5%	オフショア人民元	1.8%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	1.0%
		外国投資証券	3	0.0%	カナダ・ドル	1.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.9%
					豪ドル	0.8%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.6%
					スイス・フラン	0.8%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.6%
					デンマーク・クローネ	0.4%	ソニーグループ	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		4.0%	その他	1.2%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.5%
合計	98.7%	合計	4,781	-	合計	100.0%	合計		9.6%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(4資産分散・積極型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券	24,873,554	99.01
内 日本	24,873,554	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	249,131	0.99
純資産総額	25,122,685	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) 【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)
2023年12月末日	1,033,271	-	1.0273	-
2024年1月末日	3,090,555	-	1.0847	-
2月末日	6,526,446	-	1.1257	-
3月末日	11,017,340	-	1.1655	-
4月末日	14,872,122	-	1.1718	-
5月末日	19,694,015	-	1.1886	-
6月末日	25,122,685	-	1.2331	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	20.2

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

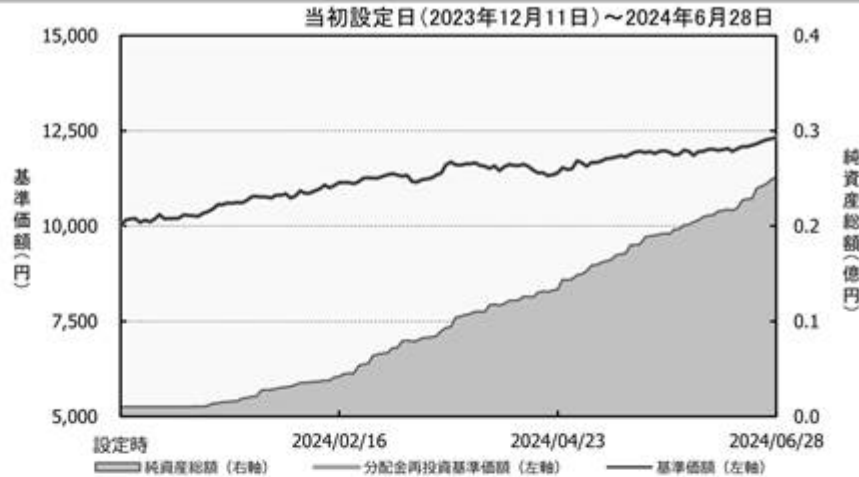
●スタイル9(4資産分散・積極型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,331円
純資産総額	25百万円



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/03/31	0円
2024/06/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

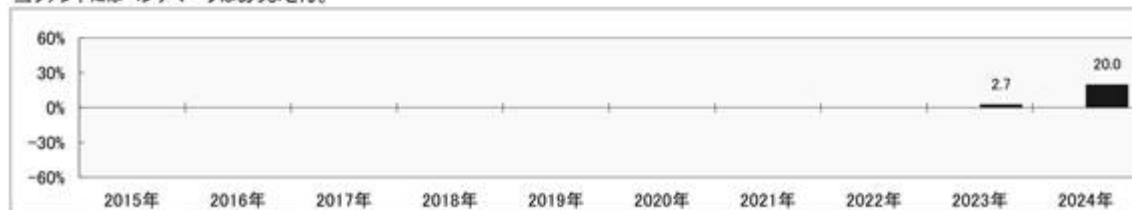
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.4%	外国株式・先物	1,178	44.6%	米ドル	42.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
トピックス・インデックス・MF	34.0%	国内株式・先物	2,120	34.0%	日本円	37.9%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
外国債券INDEXMF	16.7%	外国債券	1,003	16.3%	ユーロ	9.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.2%
日本債券INDEXMF	2.9%	国内債券	424	2.9%	英ポンド	2.7%	トヨタ自動車	日本	1.5%
		外国リート	53	0.8%	カナダ・ドル	1.7%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	1.5%
		外国投資証券	3	0.0%	オフショア人民元	1.7%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.3%
					スイス・フラン	1.2%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.9%
					豪ドル	1.1%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
					デンマーク・クローネ	0.5%	ソニーグループ	日本	0.8%
		コール・ローン、その他		4.6%	その他	1.4%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.8%
合計	99.0%	合計	4,781	-	合計	100.0%	合計		14.1%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(6資産分散・保守型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券		3,281,908	98.90
	内 日本	3,281,908	98.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		36,547	1.10
純資産総額		3,318,455	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) 【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)
2023年12月末日	1,019,641	-	1.0183	-
2024年1月末日	1,280,572	-	1.0328	-
2月末日	1,729,172	-	1.0469	-
3月末日	2,176,672	-	1.0623	-
4月末日	2,394,988	-	1.0562	-
5月末日	3,013,943	-	1.0502	-
6月末日	3,318,455	-	1.0657	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	5.6

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況(2024年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	311,455,870,100	97.02
内 日本	311,455,870,100	97.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,558,739,575	2.98
純資産総額	321,014,609,675	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)	9,559,200,000	2.98
内 日本	9,559,200,000	2.98

(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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,033,927,497	2.42
内 アメリカ	1,033,927,497	2.42
投資証券	40,609,441,629	94.90
内 ガーンジー	88,211,747	0.21
内 韓国	75,733,647	0.18
内 香港	346,283,421	0.81
内 シンガポール	1,307,133,049	3.05
内 イスラエル	40,888,106	0.10
内 イギリス	2,001,788,430	4.68
内 アイルランド	11,447,520	0.03
内 オランダ	65,213,272	0.15
内 ベルギー	378,498,310	0.88
内 フランス	651,726,926	1.52
内 ドイツ	13,483,692	0.03
内 スペイン	156,297,844	0.37
内 イタリア	2,104,263	0.00
内 カナダ	568,333,978	1.33
内 アメリカ	31,632,968,644	73.93
内 オーストラリア	3,152,819,758	7.37
内 ニュージーランド	116,509,022	0.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,146,259,670	2.68
純資産総額	42,789,628,796	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)	1,162,760,931	2.72
内 ドイツ	294,529,203	0.69
内 アメリカ	868,231,728	2.03
為替予約取引(買建)	319,149,268	0.75
内 日本	319,149,268	0.75

(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。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(6資産分散・保守型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,657円
純資産総額	3百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	0.3%
6カ月間	4.7%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	6.6%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/03/31	0円
2024/06/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

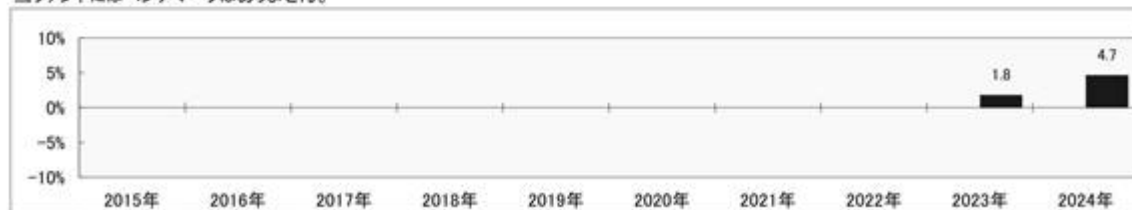
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.5%	国内債券	424	59.1%	日本円	77.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%
外国株式INDEXMF	16.6%	外国株式・先物	1,178	16.3%	米ドル	16.3%	APPLE INC	アメリカ	0.8%
トピックス・インデックス・MF	12.9%	国内株式・先物	2,120	12.9%	ユーロ	2.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.8%
ダイワJ-REIT MF	4.0%	国内リート・先物	59	4.0%	英ポンド	1.0%	トヨタ自動車	日本	0.6%
外国債券INDEXMF	3.3%	外国債券	1,003	3.2%	カナダ・ドル	0.6%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	0.5%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	2.6%	外国リート・先物	308	2.8%	豪ドル	0.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.5%
		外国投資信託等	5	0.1%	スイス・フラン	0.4%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.4%
					オフショア人民元	0.3%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
					デンマーク・クローネ	0.2%	ソニーグループ	日本	0.3%
		コール・ローン、その他		2.9%	その他	0.5%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.3%
合計	98.9%	合計	5,097	-	合計	100.0%	合計		5.2%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(6資産分散・バランス型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券	50,707,836	99.01
内 日本	50,707,836	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	509,592	0.99
純資産総額	51,217,428	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) 【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)
2023年12月末日	1,076,223	-	1.0243	-
2024年1月末日	7,046,777	-	1.0556	-
2月末日	14,271,837	-	1.0776	-
3月末日	23,383,593	-	1.1086	-
4月末日	30,618,274	-	1.1073	-
5月末日	40,600,938	-	1.1100	-
6月末日	51,217,428	-	1.1378	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	11.9

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワJ - REITマザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●スタイル9(6資産分散・バランス型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,378円
純資産総額	51百万円



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023年12月	0円
2024年1月	0円
2024年2月	0円
2024年3月	0円
2024年4月	0円
2024年5月	0円
2024年6月	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

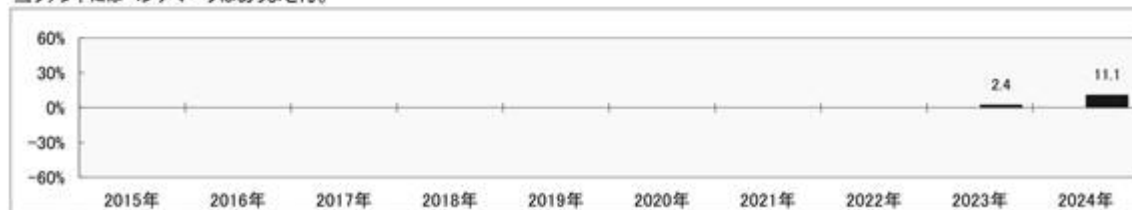
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	28.3%	外国株式・先物	1,178	27.8%	日本円	58.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.4%
日本債券INDEXMF	27.8%	国内債券	424	27.6%	米ドル	30.1%	APPLE INC	アメリカ	1.4%
トピックス・インデックス・MF	21.5%	国内株式・先物	2,120	21.5%	ユーロ	4.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.3%
ダイワJ-REIT MF	8.3%	国内リート・先物	59	8.3%	英ポンド	1.8%	トヨタ自動車	日本	0.9%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	7.0%	外国リート・先物	308	7.3%	豪ドル	1.2%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	0.9%
外国債券INDEXMF	6.1%	外国債券	1,003	6.0%	カナダ・ドル	1.1%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.8%
		外国投資信託等	5	0.2%	スイス・フラン	0.7%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.6%
					オフショア人民元	0.6%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.6%
					シンガポール・ドル	0.3%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
		コール・ローン、その他		3.7%	その他	1.1%	日本ビルファンド	日本	0.5%
合計	99.0%	合計	5,097	-	合計	100.0%	合計		8.9%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(6資産分散・積極型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券		38,538,661	99.01
	内 日本	38,538,661	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		385,953	0.99
純資産総額		38,924,614	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) 【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)
2023年12月末日	1,165,359	-	1.0299	-
2024年1月末日	5,718,210	-	1.0836	-
2月末日	10,721,311	-	1.1215	-
3月末日	16,886,782	-	1.1667	-
4月末日	22,984,798	-	1.1692	-
5月末日	30,999,866	-	1.1840	-
6月末日	38,924,614	-	1.2266	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	19.7

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考情報)運用実績

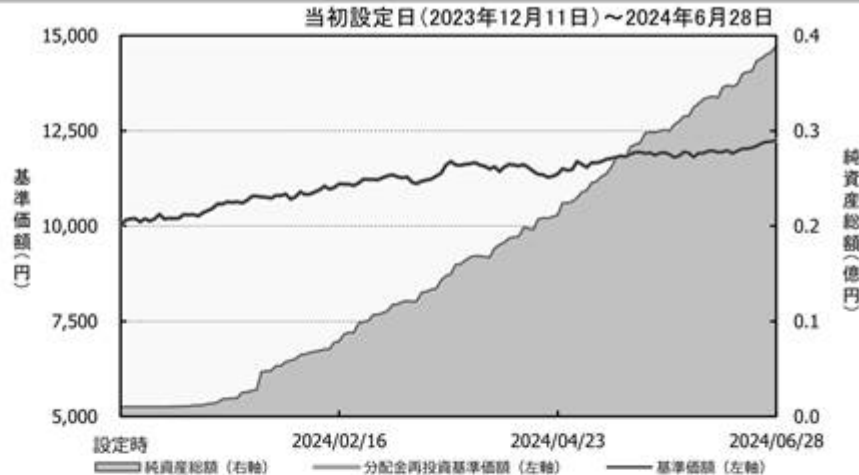
●スタイル9(6資産分散・積極型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,266円
純資産総額	38百万円



※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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円	設定来分配金合計額: 0円
分配金		

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

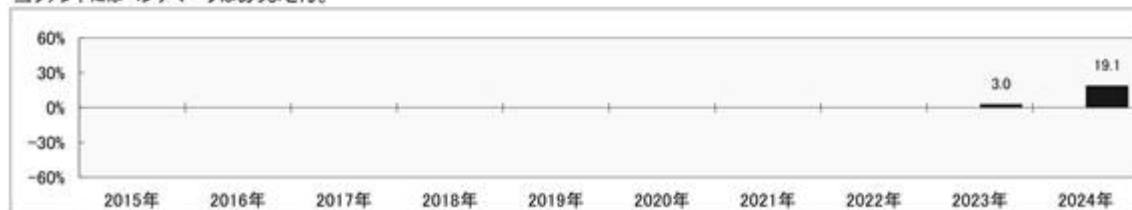
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.2%	外国株式・先物	1,178	44.4%	日本円	43.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
トピックス・インデックス・MF	33.6%	国内株式・先物	2,120	33.6%	米ドル	42.4%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	8.1%	外国リート・先物	308	8.7%	ユーロ	5.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.1%
ダイワJ-REIT MF	6.1%	国内リート・先物	59	6.1%	英ポンド	2.3%	トヨタ自動車	日本	1.4%
日本債券INDEXMF	3.0%	国内債券	424	3.0%	カナダ・ドル	1.6%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	1.4%
外国債券INDEXMF	3.0%	外国債券	1,003	2.9%	豪ドル	1.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.3%
		外国投資信託等	5	0.2%	スイス・フラン	1.2%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.9%
					デンマーク・クローネ	0.5%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
					シンガポール・ドル	0.4%	ソニーグループ	日本	0.8%
		コール・ローン、その他		4.6%	その他	1.2%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	0.8%
合計	99.0%	合計	5,097	-	合計	100.0%	合計		14.0%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(8資産分散・保守型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券		4,306,481	98.91
	内 日本	4,306,481	98.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		47,241	1.09
純資産総額		4,353,722	100.00

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

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

(2) 【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)
2023年12月末日	1,019,347	-	1.0181	-
2024年1月末日	1,353,550	-	1.0321	-
2月末日	1,801,271	-	1.0470	-
3月末日	2,432,359	-	1.0618	-
4月末日	2,981,980	-	1.0570	-
5月末日	3,880,282	-	1.0512	-
6月末日	4,353,722	-	1.0666	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日 ~ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日 ~ 2024年6月10日	5.7

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

新興国株式インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況(2024年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	43,822,798	83.09
内 アメリカ	43,822,798	83.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,921,318	16.91
純資産総額	52,744,116	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	8,747,712	16.59

	内 アメリカ	8,747,712	16.59
為替予約取引(買建)		2,976,620	5.64
	内 日本	2,976,620	5.64

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

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

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

(注4) 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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年6月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	46,812,100,748	94.95
内 中国	4,886,491,287	9.91
内 タイ	4,536,401,112	9.20
内 マレーシア	4,904,360,094	9.95
内 インドネシア	4,884,299,549	9.91
内 ポーランド	3,820,010,624	7.75
内 ハンガリー	1,393,564,229	2.83
内 ルーマニア	1,915,881,646	3.89
内 トルコ	667,079,822	1.35
内 チェコ	2,988,278,844	6.06
内 メキシコ	4,409,993,619	8.94
内 ドミニカ共和国	72,815,924	0.15
内 コロンビア	2,042,306,222	4.14
内 ベルギー	1,077,119,188	2.18
内 チリ	790,558,680	1.60
内 ブラジル	4,136,250,491	8.39
内 ウルグアイ	102,280,507	0.21
内 南アフリカ	4,184,408,910	8.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,490,355,049	5.05
純資産総額	49,302,455,797	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)	551,241,760	1.12
内 日本	551,241,760	1.12

(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。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(8資産分散・保守型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,666円
純資産総額	4百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	0.5%
6カ月間	4.8%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	6.7%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/03/31	0円
2024/06/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

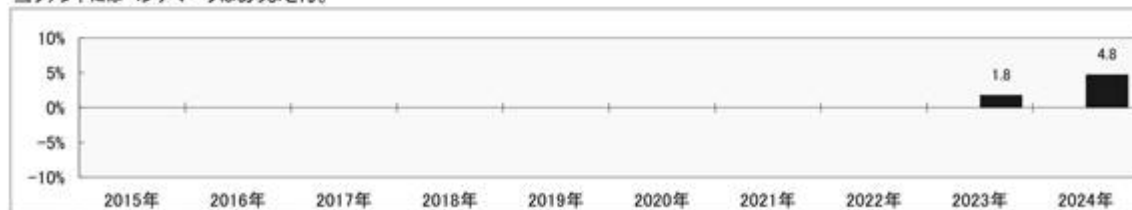
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.1%	国内債券	424	58.7%	日本円	76.6%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	1.5%
外国株式INDEXMF	15.0%	外国株式・先物	1,179	15.0%	米ドル	16.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
トピックス・インデックス・MF	12.9%	国内株式・先物	2,120	12.9%	ユーロ	2.4%	APPLE INC	アメリカ	0.7%
ダイワJ-REIT MF	3.5%	国内債券	1,216	4.5%	英ポンド	0.9%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.7%
外国債券INDEXMF	3.3%	国内リート・先物	59	3.5%	カナダ・ドル	0.6%	トヨタ自動車	日本	0.6%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	2.1%	外国リート・先物	308	2.3%	豪ドル	0.5%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	0.5%
新興国株式インデックスMF	1.8%	外国投資信託等	6	1.5%	オフショア人民元	0.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.4%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	1.4%				スイス・フラン	0.4%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.4%
					デンマーク・クローネ	0.2%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
		コール・ローン、その他		3.1%	その他	1.7%	ソニーグループ	日本	0.3%
合計	98.9%	合計	5,312	-	合計	100.0%	合計		6.1%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(8資産分散・バランス型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券		41,477,578	99.00
	内 日本	41,477,578	99.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		418,749	1.00
純資産総額		41,896,327	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) 【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)
2023年12月末日	1,230,635	-	1.0238	-
2024年1月末日	5,447,446	-	1.0539	-
2月末日	11,202,575	-	1.0765	-
3月末日	18,185,352	-	1.1057	-
4月末日	25,328,982	-	1.1074	-
5月末日	34,356,716	-	1.1105	-
6月末日	41,896,327	-	1.1374	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日 ~ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日 ~ 2024年6月10日	11.8

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITマザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」の記載と同じ。

—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」の記載と同じ。

(参考情報)運用実績

●スタイル9(8資産分散・バランス型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,374円
純資産総額	41百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.4%
3カ月間	2.9%
6カ月間	11.1%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	13.7%

※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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	2023/12/31	2024/03/31	2024/06/30	2024/09/30	2023/12/31	2024/03/31	2024/06/30	2024/09/30
分配金								

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

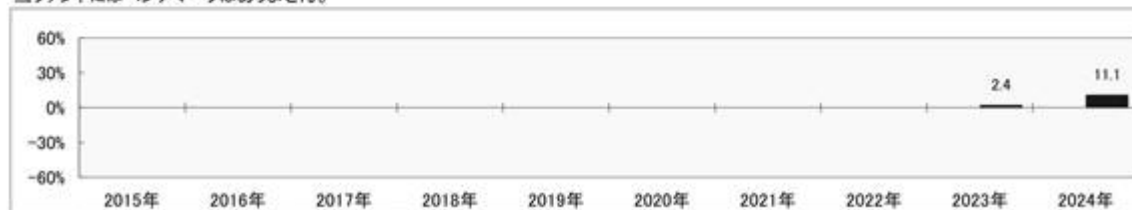
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	26.2%	国内債券	424	26.0%	日本円	55.8%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	2.6%
外国株式INDEXMF	24.9%	外国株式・先物	1,179	24.9%	米ドル	30.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.2%
トピックス・インデックス・MF	21.2%	国内株式・先物	2,120	21.2%	ユーロ	4.6%	APPLE INC	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	7.4%	外国債券	1,216	10.3%	英ポンド	1.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.2%
外国債券INDEXMF	7.3%	国内リート・先物	59	7.4%	オフショア人民元	1.1%	トヨタ自動車	日本	0.9%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	5.6%	外国リート・先物	308	5.9%	豪ドル	1.0%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	0.8%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	3.3%	外国投資信託等	6	2.7%	カナダ・ドル	1.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.7%
新興国株式インデックスMF	3.1%				スイス・フラン	0.6%	TOPIX 先物 0609月	日本	0.6%
					マレーシア・リンギット	0.4%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
		コール・ローン、その他		4.2%	その他	3.9%	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) SEP 24	アメリカ	0.5%
合計	99.0%	合計	5,312	-	合計	100.0%	合計		10.2%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【スタイル9(8資産分散・積極型)】

(1) 【投資状況】(2024年6月28日現在)

投資状況

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

親投資信託受益証券	72,443,526	99.01
内 日本	72,443,526	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	724,854	0.99
純資産総額	73,168,380	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) 【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)
2023年12月末日	1,178,165	-	1.0284	-
2024年1月末日	8,069,441	-	1.0832	-
2月末日	19,350,116	-	1.1258	-
3月末日	31,928,478	-	1.1686	-
4月末日	41,060,191	-	1.1746	-
5月末日	57,091,123	-	1.1910	-
6月末日	73,168,380	-	1.2337	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	20.3

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」の記載と同じ。

日本債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国株式インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

外国債券インデックスマザーファンド

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワJ - REITマザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

新興国株式インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

前記「スタイル9（8資産分散・保守型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

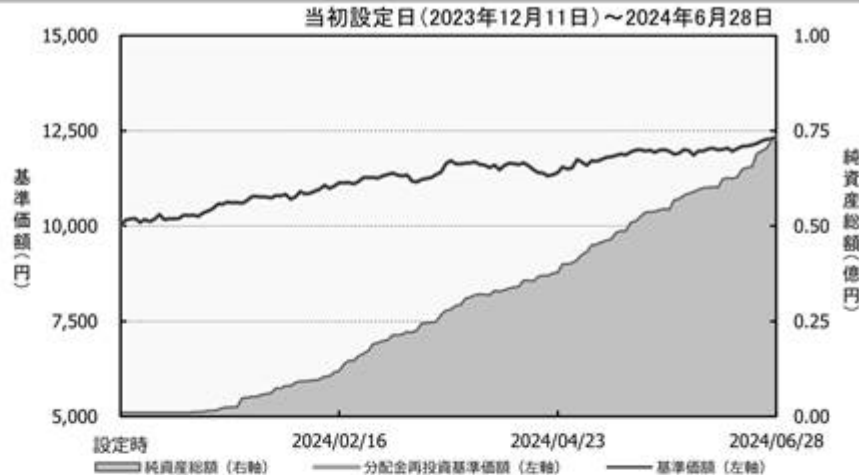
●スタイル9(8資産分散・積極型)

2024年6月28日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,337円
純資産総額	73百万円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	5.6%
6カ月間	20.0%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	23.4%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	分配金
2023/12/31	0円
2024/3/31	0円
2024/6/28	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

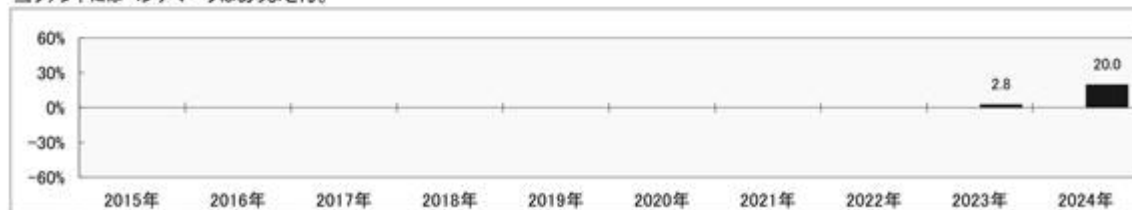
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	43.6%	外国株式・先物	1,179	43.6%	米ドル	42.6%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	3.7%
トピックス・インデックス・MF	35.7%	国内株式・先物	2,120	35.7%	日本円	41.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.1%
外国債券INDEXMF	4.6%	外国債券	1,216	6.7%	ユーロ	5.4%	APPLE INC	アメリカ	2.1%
新興国株式インデックスMF	4.4%	外国リート・先物	308	3.9%	英ポンド	2.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.1%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	3.2%	外国投資信託等	6	3.8%	カナダドル	1.5%	トヨタ自動車	日本	1.5%
日本債券INDEXMF	2.9%	国内債券	424	2.9%	豪ドル	1.2%	S&P500 EMINI SEP 24	アメリカ	1.4%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	2.3%	国内リート・先物	59	2.2%	スイス・フラン	1.1%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	2.2%				オフショア人民元	0.7%	TOPIX 先物 0609月	日本	1.0%
					デンマーク・クローネ	0.5%	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
		コール・ローン、その他		5.3%	その他	3.2%	ソニーグループ	日本	0.8%
合計	99.0%	合計	5,312	-	合計	100.0%	合計		16.9%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2023年は設定日(12月11日)から年末、2024年は6月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

2 【設定及び解約の実績】

スタイル9(4資産分散・保守型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	3,172,905	36,925

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(4資産分散・バランス型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	18,302,563	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(4資産分散・積極型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	16,754,437	192,838

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(6資産分散・保守型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	1,903,955	26,064

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(6資産分散・バランス型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	37,741,520	1,199,502

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(6資産分散・積極型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	27,165,171	171,838

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(8資産分散・保守型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	2,902,840	26,064

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(8資産分散・バランス型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	31,411,504	262,031

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

スタイル9(8資産分散・積極型)

	設定数量(口)	解約数量(口)
2023年12月11日～ 2024年6月10日	50,308,253	1,345,612

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

3 【ファンドの経理状況】

【スタイル9(4資産分散・保守型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9(4資産分散・保守型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	75,033
親投資信託受益証券	4,350,253
流動資産合計	4,425,286
資産合計	4,425,286
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,023
未払受託者報酬	199
未払委託者報酬	8,534
その他未払費用	182
流動負債合計	13,938
負債合計	13,938
純資産の部	
元本等	
元本	1 4,135,980
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	275,368
元本等合計	4,411,348
純資産合計	4,411,348
負債純資産合計	4,425,286

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
有価証券売買等損益	107,353
営業収益合計	107,353
営業費用	
受託者報酬	199
委託者報酬	8,534
その他費用	182
営業費用合計	8,915
営業利益又は営業損失()	98,438
経常利益又は経常損失()	98,438
中間純利益又は中間純損失()	98,438
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,399
剰余金増加額又は欠損金減少額	179,398
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	179,398
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,069
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,069
中間剰余金又は中間欠損金()	275,368

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	3,172,905円
期中一部解約元本額	36,925円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,135,980口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0666円 (10,666円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,237,788,832
株式	2 3 353,501,263,700
派生商品評価勘定	67,331,450
未収入金	786,100
未収配当金	2,314,834,458

前払金		17,584,900
その他未収収益	4	22,294,093
差入委託証拠金		8,363,643
流動資産合計		369,170,247,176
資産合計		369,170,247,176
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		8,730,400
未払解約金		81,408,870
受入担保金		7,952,541,165
流動負債合計		8,042,680,435
負債合計		8,042,680,435
純資産の部		
元本等		
元本	1	178,724,665,710
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		182,402,901,031
元本等合計		361,127,566,741
純資産合計		361,127,566,741
負債純資産合計		369,170,247,176

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	166,605,835,445円
期中追加設定元本額	20,604,121,880円
期中一部解約元本額	8,485,291,615円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	2,806,073,853円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,077,382,322円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	907,970円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	9,102,808円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	139,851,291円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,667,234円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	344,658,301円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,210,101,426円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	723,824,297円
D-I's TOPIXインデックス	12,954,496円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,438,554円
iFree TOPIXインデックス	8,014,577,505円
iFree 8資産バランス	4,633,476,795円
iFree 年金バランス	1,084,906,542円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,311,526円
DCダイワ日本株式インデックス	71,152,603,641円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,000,894,485円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,895,275,365円

ダイワ・ライフ・バランス70	5,876,570,899円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,730,085,839円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,651,728円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	72,192,489円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,666,958,582円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,110,455円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,970,580円
ダイワつみたてインデックスバランス70	32,037,272円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	17,564,983,933円
ダイワ世界バランスファンド40VA	46,931,794円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,120,292円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,221,061,434円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	320,340,775円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	40,650,926円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	59,424,894円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	241,819,699円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	12,824,812,809円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	9,320,434,353円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,361,066,226円
スタイル9(4資産分散・保守型)	302,513円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	2,486,723円
スタイル9(4資産分散・積極型)	3,500,292円
スタイル9(6資産分散・保守型)	189,174円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	4,403,107円
スタイル9(6資産分散・積極型)	5,524,078円
スタイル9(8資産分散・保守型)	255,860円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	3,728,318円
スタイル9(8資産分散・積極型)	10,546,911円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,058,709,466円
ダイワライフスタイル25	93,590,273円
ダイワライフスタイル50	442,282,761円
ダイワライフスタイル75	381,821,856円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	7,886,090,988円
計	178,724,665,710円
2. 期末日における受益権の総数	178,724,665,710口

3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,623,340,980円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 774,470,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年6月10日現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		うち 1年超 (円)	
市場取引			
株価指数			
先物取引			

買建	7,365,187,100	-	7,423,935,000	58,747,900
合計	7,365,187,100	-	7,423,935,000	58,747,900

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	2.0206円
(1万口当たり純資産額)	(20,206円)

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,262,563,255
国債証券	97,089,697,070
地方債証券	6,951,088,300
特殊債券	3,930,163,800
社債券	8,913,789,400
未収利息	259,926,599
前払費用	22,076,829
流動資産合計	118,429,305,253
資産合計	118,429,305,253
負債の部	

流動負債		
未払金		569,442,800
未払解約金		69,775,337
流動負債合計		639,218,137
負債合計		639,218,137
純資産の部		
元本等		
元本	1	89,915,283,415
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,874,803,701
元本等合計		117,790,087,116
純資産合計		117,790,087,116
負債純資産合計		118,429,305,253

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12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	82,847,069,539円
期中追加設定元本額	14,489,970,364円
期中一部解約元本額	7,421,756,488円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	34,251,260円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	214,018,411円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	41,043,894円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	510,580,994円
DCダイワ日本債券インデックス	10,338,366,887円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	15,780,316,326円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,264,253,756円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,455,576,148円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	186,728,513円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	207,601,314円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	61,496,904円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	28,693,048,522円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	14,409,310,807円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,728,285,466円
スタイル9(4資産分散・保守型)	2,000,397円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	4,554,913円
スタイル9(4資産分散・積極型)	475,529円
スタイル9(6資産分散・保守型)	1,385,212円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	8,962,147円
スタイル9(6資産分散・積極型)	780,987円
スタイル9(8資産分散・保守型)	1,855,405円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	7,199,075円
スタイル9(8資産分散・積極型)	1,362,640円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	732,228,269円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,942,662,122円
ダイワライフスタイル25	457,756,265円
ダイワライフスタイル50	637,936,748円
ダイワライフスタイル75	191,244,504円
計	89,915,283,415円
2. 期末日における受益権の総数	89,915,283,415口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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

2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	1.3100円
(1万口当たり純資産額)	(13,100円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,930,326,565
コール・ローン	10,462,214,098
株式	540,797,653,513
投資証券	10,485,705,109
派生商品評価勘定	361,613,266

未収入金		2,012,502
未収配当金		775,526,462
差入委託証拠金		11,800,894,266
流動資産合計		576,615,945,781
資産合計		576,615,945,781
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		72,734,053
未払解約金		108,909,100
流動負債合計		181,643,153
負債合計		181,643,153
純資産の部		
元本等		
元本	1	87,583,984,765
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		488,850,317,863
元本等合計		576,434,302,628
純資産合計		576,434,302,628
負債純資産合計		576,615,945,781

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

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

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	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	78,820,737,443円
期中追加設定元本額	12,096,328,900円
期中一部解約元本額	3,333,081,578円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスVA	231,924,751円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	1,404,824円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	18,302,724円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,622,837円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	105,788,926円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	104,497,185円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	81,610,632円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,603,767,785円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	762,944,628円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	5,182,149,127円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	565,240,433円

D - I ' s 外国株式インデックス	16,287,042円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	48,110,027円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	8,566,501,959円
i F r e e 8資産バランス	1,461,674,755円
i F r e e 年金バランス	335,640,155円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	15,357,059円
DCダイワ外国株式インデックス	49,970,444,432円
ダイワ・ライフ・バランス30	477,972,535円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,038,626,103円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,023,255,355円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,367,120,837円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,967,900円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,407,823円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,480,380,928円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,895,870円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,480,657円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,519,346円
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	14,779,406円
ダイワ世界バランスファンド40VA	43,911,825円
ダイワ世界バランスファンド60VA	29,814,954円
ダイワ・バランスファンド35VA	753,573,930円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	43,613,830円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	127,189,928円
スタイル9(4資産分散・保守型)	124,453円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	1,025,647円
スタイル9(4資産分散・積極型)	1,465,047円
スタイル9(6資産分散・保守型)	76,460円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	1,809,283円
スタイル9(6資産分散・積極型)	2,305,764円
スタイル9(8資産分散・保守型)	93,292円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	1,355,580円
スタイル9(8資産分散・積極型)	4,020,419円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,293,418,773円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	422,158,169円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,886,002,059円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,163,047,018円
ダイワライフスタイル25	7,260,567円

ダイワライフスタイル50	34,810,291円
ダイワライフスタイル75	29,773,464円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	81,305,208円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資家専用)	78,711,436円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資家専用)	68,441,327円
計	87,583,984,765円
2. 期末日における受益権の総数	87,583,984,765口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2024年6月10日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	時価		
		うち 1年超	(円)	
市場取引				
株価指数				
先物取引				

買建	25,229,831,987	-	25,542,161,650	312,329,663
合計	25,229,831,987	-	25,542,161,650	312,329,663

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	10,747,008,010	-	10,723,557,560	23,450,450
アメリカ・ドル	5,512,618,130	-	5,521,273,000	8,654,870
イギリス・ ポンド	578,355,880	-	577,085,500	1,270,380
オーストラリ ア・ドル	667,267,030	-	658,698,880	8,568,150
カナダ・ドル	1,482,550,340	-	1,466,536,500	16,013,840
スイス・フラン	1,028,102,860	-	1,031,722,970	3,620,110
ユーロ	1,478,113,770	-	1,468,240,710	9,873,060
合計	10,747,008,010	-	10,723,557,560	23,450,450

(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)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	6.5815円
(1万口当たり純資産額)	(65,815円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,084,058,151
コール・ローン	1,994,730,566
国債証券	313,363,312,761
派生商品評価勘定	2,677,328
未収利息	2,193,927,097
前払費用	159,381,696
流動資産合計	319,798,087,599
資産合計	319,798,087,599
負債の部	

流動負債		
派生商品評価勘定		12,731,515
未払解約金		81,396,260
流動負債合計		94,127,775
負債合計		94,127,775
純資産の部		
元本等		
元本	1	86,600,451,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		233,103,508,043
元本等合計		319,703,959,824
純資産合計		319,703,959,824
負債純資産合計		319,798,087,599

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	82,533,998,623円
期中追加設定元本額	7,891,826,075円
期中一部解約元本額	3,825,372,917円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスVA	349,564,239円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,950,980円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	32,397,835円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	14,812,611円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	185,995,811円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	728,299,705円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	590,336,025円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス	944,806,326円
エマージングプラス(為替ヘッジなし)	
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	4,863,672,454円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	1,136,033,036円

D - I ' s 外国債券インデックス	1,757,072円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,269,499円
i F r e e 外国債券インデックス	2,090,162,704円
i F r e e 8資産バランス	2,509,065,680円
i F r e e 年金バランス	590,058,228円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	1,795,132円
DCダイワ外国債券インデックス	51,746,568,139円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,176,216,933円
ダイワ・ライフ・バランス50	874,361,044円
ダイワ・ライフ・バランス70	710,693,395円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	711,232,725円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	577,697,326円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	235,553,770円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	35,040,686円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	21,454,343円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,284,035,428円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,872,476円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,179,468円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,884,824円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	1,799,268,308円
ダイワ世界バランスファンド40VA	90,058,800円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,205,450円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,632,807,131円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	170,383,732円
スタイル9(4資産分散・保守型)	81,098円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	1,061,653円
スタイル9(4資産分散・積極型)	953,525円
スタイル9(6資産分散・保守型)	26,750円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	693,910円
スタイル9(6資産分散・積極型)	267,171円
スタイル9(8資産分散・保守型)	35,928円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	707,850円
スタイル9(8資産分散・積極型)	754,502円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	139,399,701円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,464,520円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,239,762,643円

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,878,576,536円
ダイワライフスタイル25	25,417,573円
ダイワライフスタイル50	59,465,670円
ダイワライフスタイル75	17,291,436円
計	86,600,451,781円
2. 期末日における受益権の総数	86,600,451,781口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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	2024年6月10日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,041,829,919	-	2,031,775,732	10,054,187
アメリカ・ドル	634,312,324	-	636,554,640	2,242,316

イギリス・ ポンド	36,647,069	-	36,680,446	33,377
オフショア・ 人民元	765,547,379	-	765,820,773	273,394
カナダ・ドル	168,635,030	-	167,116,950	1,518,080
シンガポ ール・ドル	51,914,150	-	51,852,998	61,152
ニュージ ーランド・ドル	15,374,640	-	15,266,400	108,240
ノルウェ ー・クローネ	12,131,042	-	11,874,876	256,166
メキシコ ・ペソ	148,292,739	-	137,720,487	10,572,252
ユーロ	208,975,546	-	208,888,162	87,384
合計	2,041,829,919	-	2,031,775,732	10,054,187

(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)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	3.6917円
(1万口当たり純資産額)	(36,917円)

【スタイル9(4資産分散・バランス型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（4資産分散・バランス型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	319,153
親投資信託受益証券	21,661,207
流動資産合計	21,980,360
資産合計	21,980,360
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	952
未払委託者報酬	34,636
その他未払費用	345
流動負債合計	35,933
負債合計	35,933
純資産の部	
元本等	
元本	19,302,563
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,641,864
元本等合計	21,944,427
純資産合計	21,944,427
負債純資産合計	21,980,360

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	840,407
営業収益合計	840,408
営業費用	
受託者報酬	952
委託者報酬	34,636
その他費用	345
営業費用合計	35,933
営業利益又は営業損失()	804,475
経常利益又は経常損失()	804,475
中間純利益又は中間純損失()	804,475
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,837,389
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,837,389
中間剰余金又は中間欠損金()	2,641,864

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	18,302,563円
期中一部解約元本額	- 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	19,302,563口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1369円 (11,369円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(4資産分散・積極型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（4資産分散・積極型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	275,962
親投資信託受益証券	20,857,966
流動資産合計	21,133,928
資産合計	21,133,928
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	897
未払委託者報酬	33,233
その他未払費用	337
流動負債合計	34,467
負債合計	34,467
純資産の部	
元本等	
元本	17,561,599
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,537,862
元本等合計	21,099,461
純資産合計	21,099,461
負債純資産合計	21,133,928

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,221,166
営業収益合計	1,221,166
営業費用	
受託者報酬	897
委託者報酬	33,233
その他費用	337
営業費用合計	34,467
営業利益又は営業損失()	1,186,699
経常利益又は経常損失()	1,186,699
中間純利益又は中間純損失()	1,186,699
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	11,388
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,383,023
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,383,023
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,472
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,472
中間剰余金又は中間欠損金()	3,537,862

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	16,754,437円
期中一部解約元本額	192,838円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	17,561,599口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2015円 (12,015円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(6資産分散・保守型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（6資産分散・保守型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,011
親投資信託受益証券	2,997,499
流動資産合計	3,046,510
資産合計	3,046,510
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	168
未払委託者報酬	6,943
その他未払費用	182
流動負債合計	7,293
負債合計	7,293
純資産の部	
元本等	
元本	2,877,891
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	161,326
元本等合計	3,039,217
純資産合計	3,039,217
負債純資産合計	3,046,510

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
有価証券売買等損益	75,799
営業収益合計	75,799
営業費用	
受託者報酬	168
委託者報酬	6,943
その他費用	182
営業費用合計	7,293
営業利益又は営業損失()	68,506
経常利益又は経常損失()	68,506
中間純利益又は中間純損失()	68,506
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,159
剰余金増加額又は欠損金減少額	94,446
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	94,446
剰余金減少額又は欠損金増加額	467
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467
中間剰余金又は中間欠損金()	161,326

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,903,955円
期中一部解約元本額	26,064円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,877,891口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0561円 (10,561円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-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

	2024年6月10日現在 金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,401,367,809
投資証券	2	321,289,532,700
派生商品評価勘定		18,984,000
未収入金		768,527,314
未収配当金		2,525,567,554
差入委託証拠金		523,925,288
流動資産合計		332,527,904,665
資産合計		332,527,904,665
負債の部		
流動負債		
前受金		146,440,000
未払解約金		1,547,596,000
流動負債合計		1,694,036,000
負債合計		1,694,036,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	104,456,987,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		226,376,880,768
元本等合計		330,833,868,665
純資産合計		330,833,868,665
負債純資産合計		332,527,904,665

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	128,388,251,898円
期中追加設定元本額	4,076,424,233円
期中一部解約元本額	28,007,688,234円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - REITオープン	3,745,632,318円
ダイワJ - REITオープン（毎月分配型）	85,361,515,896円
ダイワJ - REITオープン（年1回決算型）	562,922,782円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	24,474,019円
iFree J - REITインデックス	676,808,003円
iFree 8資産バランス	2,825,040,407円

ダイワJ - REITオープン(奇数月決算型)	96,455,136円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	290,859円
DC・ダイワJ - REITオープン	5,292,218,514円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,088,555円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,224,791円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	5,527,889円
ダイワ・ノーロード J - REITファンド	89,369,037円
ダイワファンドラップ J - REITインデックス	3,685,520,892円
ダイワJ - REITインデックス(ダイワSMA専用)	728,637,805円
ダイワファンドラップオンライン J - REITインデックス	590,480,249円
スタイル9(6資産分散・保守型)	38,043円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	1,107,024円
スタイル9(6資産分散・積極型)	652,791円
スタイル9(8資産分散・保守型)	45,627円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	845,957円
スタイル9(8資産分散・積極型)	429,651円
ダイワ・インデックスセレクト J - REIT	749,661,652円
計	104,456,987,897円
2. 期末日における受益権の総数	104,456,987,897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 1,473,050,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(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	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	9,520,000,000	-	9,539,600,000	19,600,000
合計	9,520,000,000	-	9,539,600,000	19,600,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	3.1672円
(1万口当たり純資産額)	(31,672円)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	396,739,993
コール・ローン	328,301,140
投資信託受益証券	1,647,732,024
投資証券	38,667,347,934
派生商品評価勘定	10,281,272
未収入金	979,811
未収配当金	63,399,165
差入委託証拠金	417,953,180
流動資産合計	41,532,734,519
資産合計	41,532,734,519
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,807,149
未払金	61,227,463
未払解約金	11,295,000
流動負債合計	127,329,612
負債合計	127,329,612
純資産の部	
元本等	
元本	1 10,963,303,297
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,442,101,610
元本等合計	41,405,404,907
純資産合計	41,405,404,907
負債純資産合計	41,532,734,519

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、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。

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)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

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

(1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>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	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	10,448,984,136円
期中追加設定元本額	1,109,324,022円
期中一部解約元本額	595,004,861円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	89,113,817円
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	1,932,074,625円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	351,158,407円
D-I's グローバルREITインデックス	1,440,687円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,124,448円
iFree 外国REITインデックス	653,160,526円
iFree 8資産バランス	2,475,793,628円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	365,461,780円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	235,211,968円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,269,950円

DCダイワ・グローバルREITインデックス ファンド	4,121,296,830円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,873,187円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,756,308円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジ なし)(投資一任専用)	4,458,392円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資 家専用)	138,883,701円
スタイル9(6資産分散・保守型)	20,697円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	782,733円
スタイル9(6資産分散・積極型)	717,575円
スタイル9(8資産分散・保守型)	22,560円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	535,774円
スタイル9(8資産分散・積極型)	520,760円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルRE IT	204,433,465円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファン ド	64,464,367円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジ なし)(ダイワSMA専用)	29,211,208円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資 家専用)	88,790,418円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資 家専用)	84,431,748円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資 家専用)	80,293,738円
計	10,963,303,297円
2. 期末日における受益権の総数	10,963,303,297口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりま す。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種類	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,169,969,722	-	1,126,239,005	43,730,717
合計	1,169,969,722	-	1,126,239,005	43,730,717

(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。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月10日現在			
	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				

買建	351,136,106	-	350,340,946	795,160
アメリカ・ドル	245,716,390	-	245,707,700	8,690
ユーロ	105,419,716	-	104,633,246	786,470
合計	351,136,106	-	350,340,946	795,160

(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)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	3.7767円
(1万口当たり純資産額)	(37,767円)

【スタイル9(6資産分散・バランス型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（6資産分散・バランス型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	496,070
親投資信託受益証券	41,569,146
流動資産合計	42,065,216
資産合計	42,065,216
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,910
未払委託者報酬	68,812
その他未払費用	693
流動負債合計	71,415
負債合計	71,415
純資産の部	
元本等	
元本	37,542,018
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,451,783
元本等合計	41,993,801
純資産合計	41,993,801
負債純資産合計	42,065,216

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
受取利息	32
有価証券売買等損益	1,377,446
営業収益合計	1,377,478
営業費用	
受託者報酬	1,910
委託者報酬	68,812
その他費用	693
営業費用合計	71,415
営業利益又は営業損失()	1,306,063
経常利益又は経常損失()	1,306,063
中間純利益又は中間純損失()	1,306,063
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	30,319
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,272,916
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,272,916
剰余金減少額又は欠損金増加額	96,877
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	96,877
中間剰余金又は中間欠損金()	4,451,783

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	37,741,520円
期中一部解約元本額	1,199,502円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	37,542,018口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1186円 (11,186円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(6資産分散・積極型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（6資産分散・積極型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	432,575
親投資信託受益証券	33,124,328
流動資産合計	33,556,903
資産合計	33,556,903
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,461
未払委託者報酬	52,434
その他未払費用	525
流動負債合計	54,420
負債合計	54,420
純資産の部	
元本等	
元本	1 27,993,333
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,509,150
元本等合計	33,502,483
純資産合計	33,502,483
負債純資産合計	33,556,903

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
受取利息	15
有価証券売買等損益	1,870,628
営業収益合計	1,870,643
営業費用	
受託者報酬	1,461
委託者報酬	52,434
その他費用	525
営業費用合計	54,420
営業利益又は営業損失()	1,816,223
経常利益又は経常損失()	1,816,223
中間純利益又は中間純損失()	1,816,223
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	11,015
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,723,753
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,723,753
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,811
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,811
中間剰余金又は中間欠損金()	5,509,150

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	27,165,171円
期中一部解約元本額	171,838円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	27,993,333口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1968円 (11,968円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・保守型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9（8資産分散・保守型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	52,667
親投資信託受益証券	4,052,216
流動資産合計	4,104,883
資産合計	4,104,883
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	196
未払委託者報酬	8,349
その他未払費用	182
流動負債合計	8,727
負債合計	8,727
純資産の部	
元本等	
元本	3,876,776
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	219,380
元本等合計	4,096,156
純資産合計	4,096,156
負債純資産合計	4,104,883

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
有価証券売買等損益	87,616
営業収益合計	87,616
営業費用	
受託者報酬	196
委託者報酬	8,349
その他費用	182
営業費用合計	8,727
営業利益又は営業損失()	78,889
経常利益又は経常損失()	78,889
中間純利益又は中間純損失()	78,889
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	942
剰余金増加額又は欠損金減少額	142,023
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	142,023
剰余金減少額又は欠損金増加額	590
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	590
中間剰余金又は中間欠損金()	219,380

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	2,902,840円
期中一部解約元本額	26,064円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	3,876,776口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0566円 (10,566円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	266,515,426
コール・ローン	426,501,926
国債証券	46,292,795,850

派生商品評価勘定		1,442,220
未収利息		775,065,647
前払費用		76,733,097
流動資産合計		47,839,054,166
資産合計		47,839,054,166
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		993,700
未払金		19,135,375
未払解約金		15,126
流動負債合計		20,144,201
負債合計		20,144,201
純資産の部		
元本等		
元本	1	25,367,734,980
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,451,174,985
元本等合計		47,818,909,965
純資産合計		47,818,909,965
負債純資産合計		47,839,054,166

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12月11日 至2024年6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2023年12月11日 22,947,548,923円 2,830,207,137円 410,021,080円
期末元本額の内訳 ファンド名 新興国債券インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップオンライン 外国債券イン デックス エマージングプラス（為替ヘッジな し） D - I ' s 新興国債券インデックス i F r e e 新興国債券インデックス i F r e e 8資産バランス ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジな し）（投資一任専用）	556,551,931円 459,751,982円 548,456,659円 66,260,648円 9,036,229,409円 4,847,786,913円 5,414,529円

DCダイワ新興国債券インデックスファンド	9,683,631,345円
スタイル9(8資産分散・保守型)	29,607円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	632,999円
スタイル9(8資産分散・積極型)	718,688円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	122,850,033円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	39,420,237円
計	25,367,734,980円
2. 期末日における受益権の総数	25,367,734,980口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載していません。</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>

(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	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	359,978,840	-	360,427,360	448,520

オフショア・ 人民元	17,062,320	-	17,250,880	188,560
チェコ・コル ナ	40,749,000	-	41,018,400	269,400
トルコ・リラ	32,123,700	-	32,846,800	723,100
ハンガリー・ フォリント	34,240,000	-	34,423,280	183,280
ポーランド・ ズロチ	23,355,120	-	23,433,000	77,880
メキシコ・ペソ	25,805,100	-	25,391,100	414,000
ルーマニア・ レイ	186,643,600	-	186,063,900	579,700
合計	359,978,840	-	360,427,360	448,520

(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)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	1.8850円
(1万口当たり純資産額)	(18,850円)

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	267,020
コール・ローン	3,145,777
投資証券	41,318,987
派生商品評価勘定	127,178
差入委託証拠金	5,157,190
流動資産合計	50,016,152
資産合計	50,016,152
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	129
未払解約金	1,100
流動負債合計	1,229
負債合計	1,229
純資産の部	
元本等	
元本	1 43,249,127
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,765,796
元本等合計	50,014,923
純資産合計	50,014,923
負債純資産合計	50,016,152

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12月11日 至2024年6月10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、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)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> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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	2024年6月10日現在
1. 1 期首	2023年12月11日
期首元本額	39,985,483円
期中追加設定元本額	3,325,420円
期中一部解約元本額	61,776円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
スタイル9(8資産分散・保守型)	62,686円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	948,624円
スタイル9(8資産分散・積極型)	2,313,082円
新興国株式インデックス資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用)	39,924,735円
計	43,249,127円
2. 期末日における受益権の総数	43,249,127口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	8,226,538	-	8,353,716	127,178
合計	8,226,538	-	8,353,716	127,178

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月10日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買建	2,893,714	-	2,893,585	129
アメリカ・ドル	2,893,714	-	2,893,585	129
合計	2,893,714	-	2,893,585	129

(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)

	2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	1.1564円
(1万口当たり純資産額)	(11,564円)

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(4資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(6資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・バランス型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9(8資産分散・バランス型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	505,078
親投資信託受益証券	35,492,108
流動資産合計	35,997,186
資産合計	35,997,186
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,554
未払委託者報酬	56,287
その他未払費用	574
流動負債合計	58,415
負債合計	58,415
純資産の部	
元本等	
元本	32,149,473
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	3,789,298
元本等合計	35,938,771
純資産合計	35,938,771
負債純資産合計	35,997,186

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
受取利息	21
有価証券売買等損益	1,133,408
営業収益合計	1,133,429
営業費用	
受託者報酬	1,554
委託者報酬	56,287
その他費用	574
営業費用合計	58,415
営業利益又は営業損失()	1,075,014
経常利益又は経常損失()	1,075,014
中間純利益又は中間純損失()	1,075,014
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	9,427
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,744,495
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,744,495
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,784
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,784
中間剰余金又は中間欠損金()	3,789,298

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	31,411,504円
期中一部解約元本額	262,031円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	32,149,473口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額	1,1179円
(1万口当たり純資産額)	(11,179円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

【スタイル9(8資産分散・積極型)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年12月11日から2024年6月10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。

スタイル9(8資産分散・積極型)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	768,615
親投資信託受益証券	59,699,046
流動資産合計	60,467,661
資産合計	60,467,661
負債の部	
流動負債	
未払解約金	266,895
未払受託者報酬	2,605
未払委託者報酬	93,020
その他未払費用	963
流動負債合計	363,483
負債合計	363,483
純資産の部	
元本等	
元本	¹ 49,962,641
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	10,141,537
元本等合計	60,104,178
純資産合計	60,104,178
負債純資産合計	60,467,661

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年12月11日
	至 2024年6月10日
営業収益	
受取利息	77
有価証券売買等損益	3,374,446
営業収益合計	3,374,523
営業費用	
受託者報酬	2,605
委託者報酬	93,020
その他費用	963
営業費用合計	96,588
営業利益又は営業損失()	3,277,935
経常利益又は経常損失()	3,277,935
中間純利益又は中間純損失()	3,277,935
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	77,769
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,102,869
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,102,869
剰余金減少額又は欠損金増加額	161,498
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	161,498
中間剰余金又は中間欠損金()	10,141,537

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	50,308,253円
期中一部解約元本額	1,345,612円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	49,962,641口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 2024年6月10日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年6月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2030円 (12,030円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「新興国株式インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日(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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「新興国株式インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9(8資産分散・保守型)」に記載のとおりであります。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（4資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- R E I Tマザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の状況

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」に記載のとおりであります。

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2024年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 【事業の内容及び営業の状況】

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6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	337,895
追加型株式投資信託	799	30,121,455
株式投資信託 合計	886	30,459,350
単位型公社債投資信託	99	178,805
追加型公社債投資信託	14	1,509,835
公社債投資信託 合計	113	1,688,640
総合計	999	32,147,990

(3) 【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

2024年5月15日、株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携を締結いたしました。本提携に基づき関係当局の許認可等が得られ次第、かんぽ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたします。

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。

5 【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,982	4,813
有価証券	346	503
前払費用	393	481
未収委託者報酬	12,525	16,513
未収収益	47	78
関係会社短期貸付金	22,100	23,400
その他	59	88
流動資産計	37,455	45,878
固定資産		
有形固定資産	1	176
建物	3	2
器具備品	193	174
無形固定資産	1,482	1,342
ソフトウェア	1,351	1,063
ソフトウェア仮勘定	131	279
投資その他の資産	13,824	13,660
投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180

資産合計

52,959

61,058

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	101	158
未払金	5,874	6,187
未払収益分配金	38	39
未払償還金	12	12
未払手数料	4,525	5,849
その他未払金	2	285
未払費用	3,987	5,035
未払法人税等	560	3,842
未払消費税等	327	872
賞与引当金	692	1,048
その他	2	1
流動負債計	11,545	17,146
固定負債		
退職給付引当金	2,276	2,227
役員退職慰労引当金	51	62
その他	0	-
固定負債計	2,329	2,289
負債合計	13,874	19,435
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048
福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6

固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月 31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月 31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	-	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	-
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月 31日)

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 12,737
当期純利益	-	-	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 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
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

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の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員及び参与についても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。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」のその他に表示していた171百万円は、「受取配当金」25百万円、「その他」146百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	38百万円	39百万円
器具備品	296百万円	308百万円

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
未払金	1,178百万円	236百万円

3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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

(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

2024年6月19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	11,858百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,546円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月20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（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

当事業年度（2024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	144	8,141	-	8,285
資産合計	144	8,141	-	8,285

（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	666	666
子会社株式	1,448	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（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。

当事業年度（2024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（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。

当事業年度（2024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	144	55	89
(2) その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	213
小計	1,543	1,756	213
合計	8,285	6,079	2,205

(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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

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。

当事業年度において、証券投資信託について132百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	322	266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

(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 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,276百万円	2,227百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
勤務費用	150百万円	138百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

(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184百万円、当事業年度187百万円であります。

(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 (2023年 3月31日)	当事業年度 (2024年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	459	486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	356	740
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
繰延税金負債合計	515	899
繰延税金資産の純額	824	524

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（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。

当事業年度（2024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76,221百万円、その他717百万円であります。

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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 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 -	22,100 -
-----	---------------	---------	---------	---------	--------------	----	------	-----------------------	-------------	----------------	-------------

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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	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)	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

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 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。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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)	2,354	-	-

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 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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
							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す。

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

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、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 2023年4月1日 至 2024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)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
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)	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

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

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,983.42円	1株当たり純資産額	15,956.63円
1株当たり当期純利益	3,955.35円	1株当たり当期純利益	4,546.57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、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,317	11,859
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)

(株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日(予定)
資金の用途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

独立監査人の監査報告書

2024年5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

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2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（4資産分散・保守型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（4資産分散・保守型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（4資産分散・バランス型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（4資産分散・バランス型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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に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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（4資産分散・積極型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（4資産分散・積極型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（6資産分散・保守型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（6資産分散・保守型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（6資産分散・バランス型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（6資産分散・バランス型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（6資産分散・積極型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（6資産分散・積極型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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に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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（8資産分散・保守型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（8資産分散・保守型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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に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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（8資産分散・バランス型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（8資産分散・バランス型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間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

2024年7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
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているスタイル9（8資産分散・積極型）の2023年12月11日から2024年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、スタイル9（8資産分散・積極型）の2024年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年12月11日から2024年6月10日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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。
- ・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、経営者に対して、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

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 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。