

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2024年9月3日提出

【発行者名】 大和アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 小松 幹太

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 佐竹 優子
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 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）

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 (1)当初自己設定
各ファンドについて100万円とし、合計で900万円と
します。
(2)継続申込期間
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で90兆
円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年11月24日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（2023年7月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（2024年6月末日現在） >

< 略 >

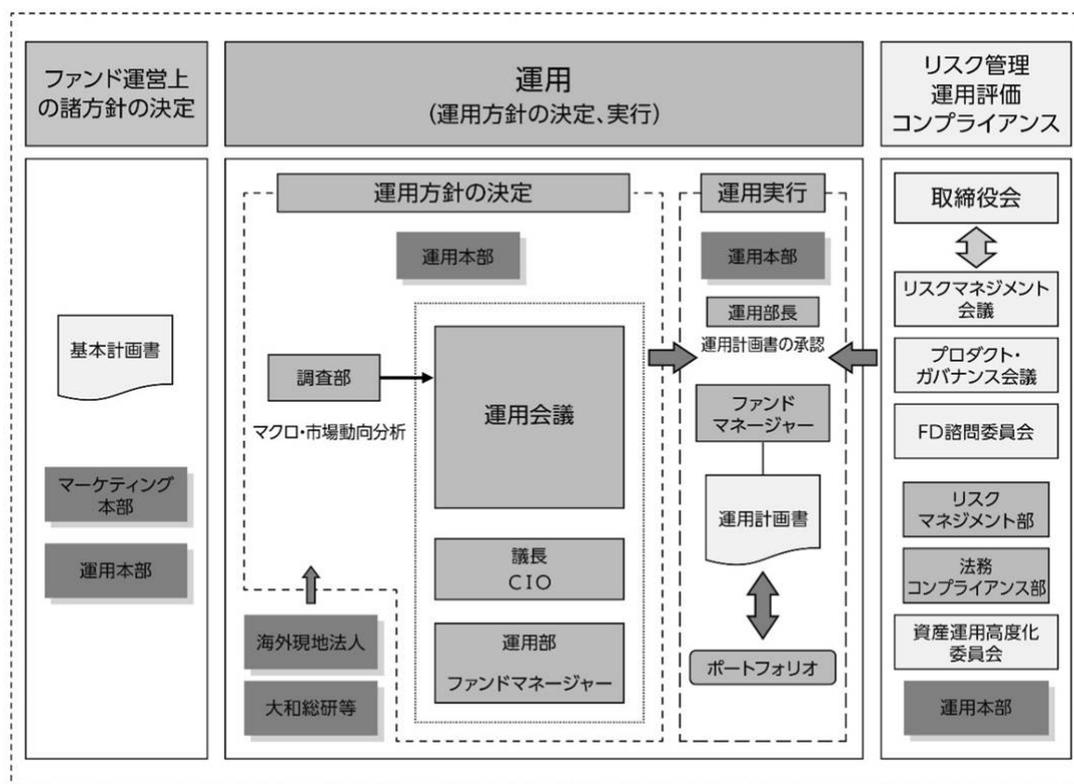
2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。なお、委託会社は、運用にあたって投資顧問会社の助言を受けます。



< 略 >

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

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は35～45名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

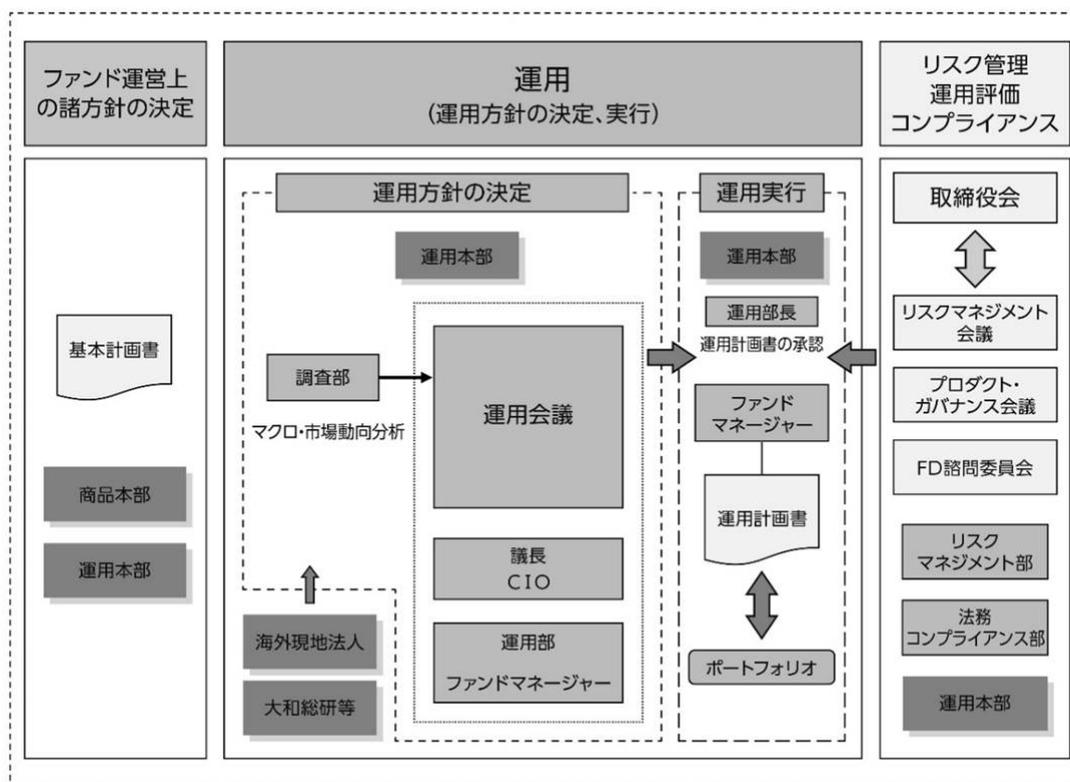
< 略 >

上記の運用体制は2023年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。なお、委託会社は、運用にあたって投資顧問会社の助言を受けます。



< 略 >

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は10～20名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役に意見を述べます。

< 略 >

上記の運用体制は2024年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

3 【投資リスク】

< 訂正前 >

< 略 >

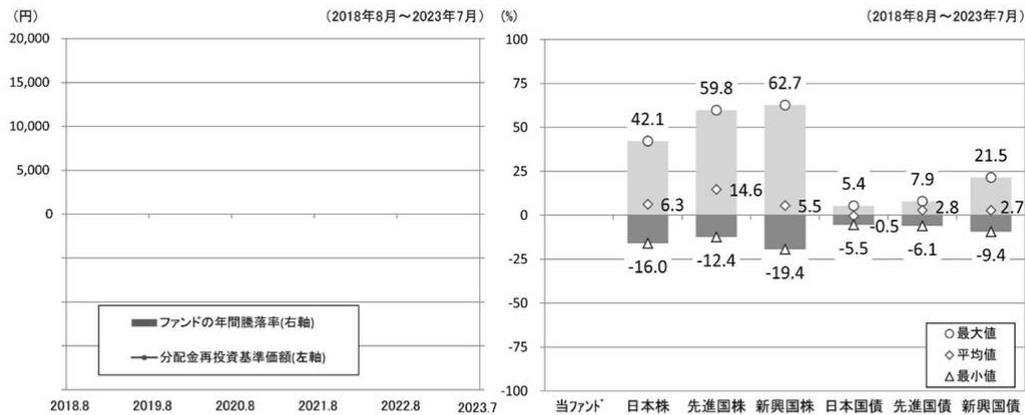
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[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)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。〔<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>〕●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

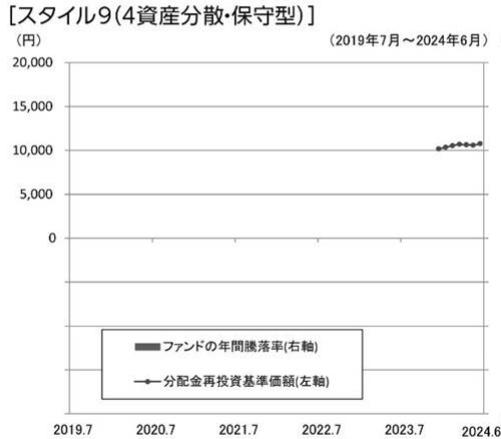
< 訂正後 >

< 略 >

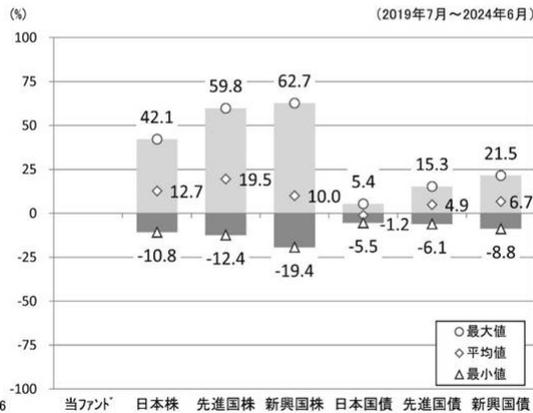
参考情報

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

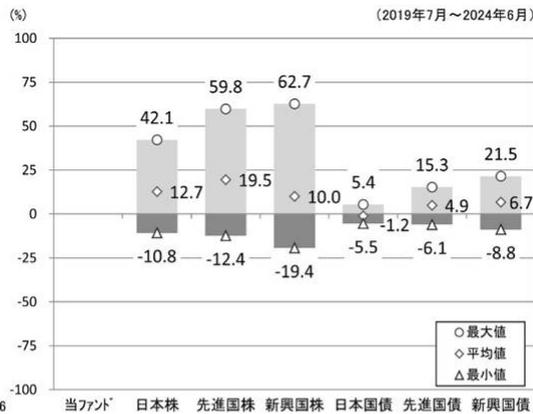
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



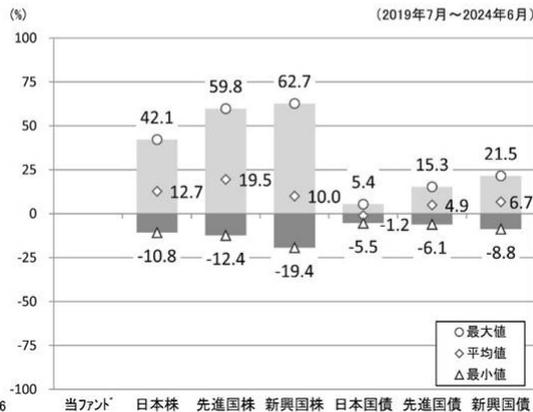
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



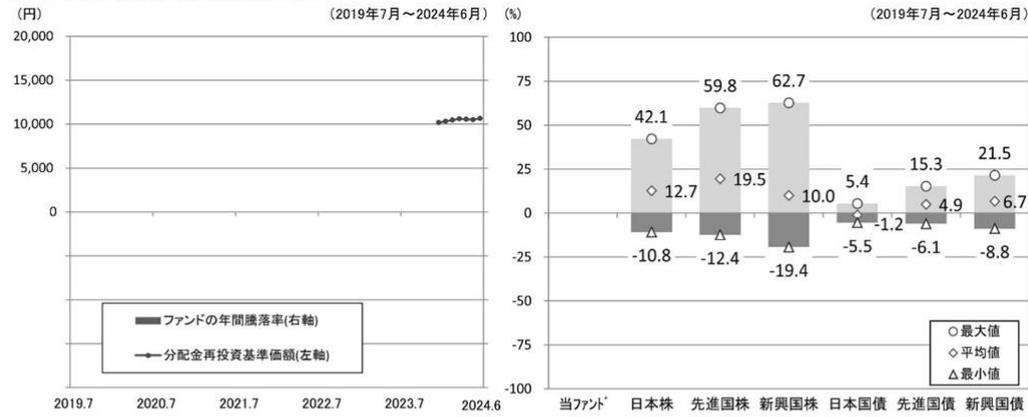
[スタイル9(4資産分散・バランス型)]



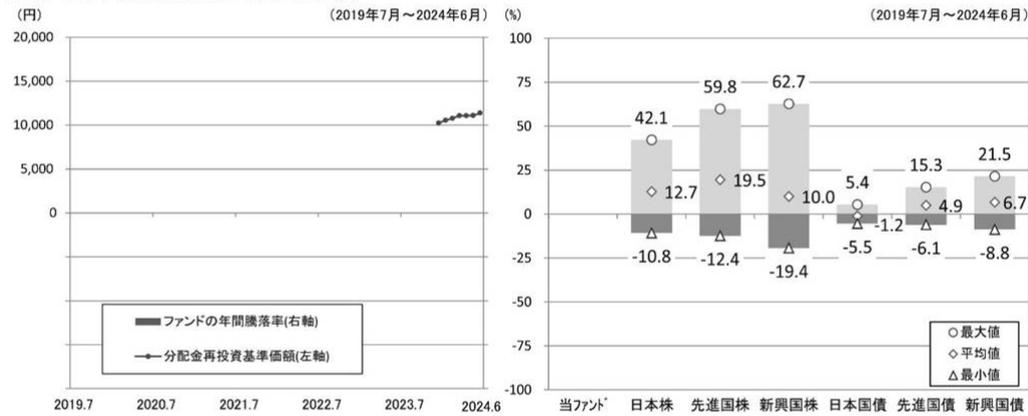
[スタイル9(4資産分散・積極型)]



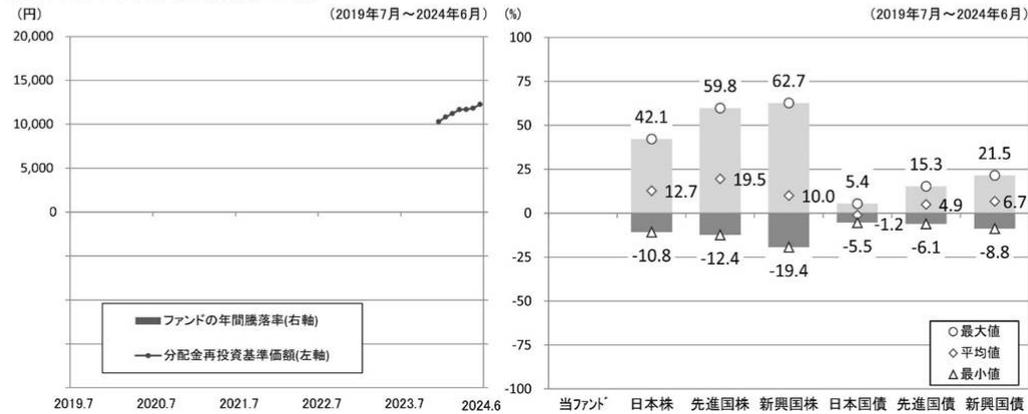
[スタイル9(6資産分散・保守型)]



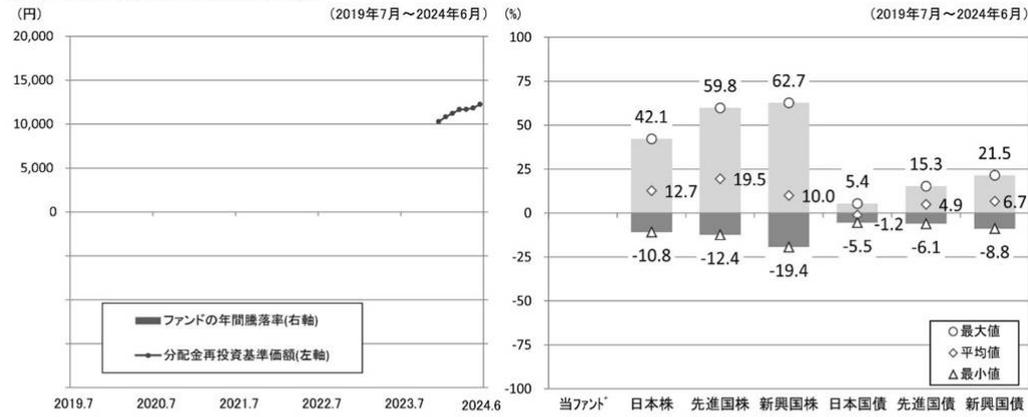
[スタイル9(6資産分散・バランス型)]



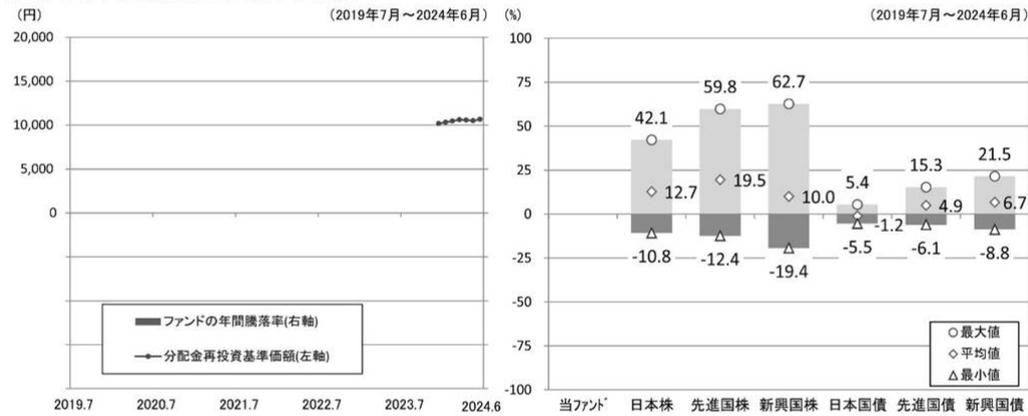
[スタイル9(6資産分散・積極型)]



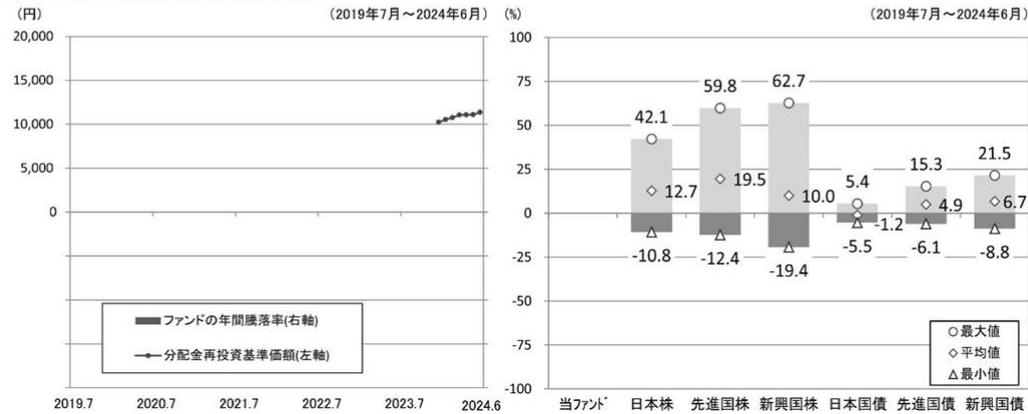
[スタイル9(8資産分散・保守型)]



[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)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. ([MSCI]) が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドに基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

< 略 >

八．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択

した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

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

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

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

「つみたてNISA」をご利用の場合

販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

毎年、一定額の範囲で販売会社との契約に基づいて定期かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年においてその両方を併用した投資は行なえません。

法人の投資者に対する課税

< 略 >

() 上記は、2023年7月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

(注) 当ファンドにおける上記の「少額投資非課税制度」に関する取扱いは、2023年12月末購入分までとなります。2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託（*）などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

* 2024年1月1日以降は一定の要件を満たした公募株式投資信託がNISAの適用対象となります。

当ファンドは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

< 訂正後 >

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

< 略 >

八．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

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

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

当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」および「つみたて投資枠(特定累積投資勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

< 略 >

- () 上記は、2024年6月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,270,713	1.3293 3,018,581	1.3093 2,973,044	58.96
2	外国株式インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	136,984	5.9490 814,921	6.8497 938,299	18.61
3	トピックス・インデクス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	352,226	1.8886 665,229	2.0425 719,421	14.27
4	外国債券インデクスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	90,997	3.5579 323,765	3.7995 345,743	6.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.70%
合計	98.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

(2) 投資資産（2024年6月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,806,500	2,911.82 13,995,664,029	3,290.00 15,813,385,000	4.31
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,423,000	1,339.55 7,264,416,382	1,729.00 9,376,367,000	2.56
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	633,200	12,834.80 8,126,999,363	13,640.00 8,636,848,000	2.35
4	日立	日本	株式	電気機器	2,194,500	2,052.34 4,503,880,005	3,601.00 7,902,394,500	2.15
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	623,600	7,691.35 4,796,331,497	10,725.00 6,688,110,000	1.82
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	191,400	21,877.97 4,187,444,776	34,900.00 6,679,860,000	1.82
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	90,500	58,615.33 5,304,687,707	70,550.00 6,384,775,000	1.74
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,836,900	2,563.66 4,709,193,646	3,148.00 5,782,561,200	1.58
9	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	669,400	5,209.22 3,487,052,923	8,607.00 5,761,525,800	1.57
10	三井物産	日本	株式	卸売業	1,433,000	2,940.63 4,213,923,838	3,651.00 5,231,883,000	1.43
11	東京海上HD	日本	株式	保険業	869,400	3,674.20 3,194,350,444	6,005.00 5,220,747,000	1.42
12	信越化学	日本	株式	化学	812,200	4,731.12 3,842,619,754	6,238.00 5,066,503,600	1.38
13	伊藤忠	日本	株式	卸売業	643,100	5,818.17 3,741,668,523	7,854.00 5,050,907,400	1.38
14	任天堂	日本	株式	その他製品	570,800	6,590.40 3,761,805,336	8,556.00 4,883,764,800	1.33
15	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	447,300	6,635.11 2,967,884,828	10,390.00 4,647,447,000	1.27
16	第一三共	日本	株式	医薬品	790,000	4,132.68 3,264,819,101	5,524.00 4,363,960,000	1.19
17	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	26,973,800	179.78 4,849,550,245	151.80 4,094,622,840	1.12
18	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,202,000	2,697.45 3,242,338,374	3,358.00 4,036,316,000	1.10
19	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,142,300	1,787.50 3,829,371,601	1,720.00 3,684,756,000	1.00
20	武田薬品	日本	株式	医薬品	802,600	4,757.69 3,818,525,075	4,172.00 3,348,447,200	0.91

21	HOYA	日本	株式	精密機器	178,000	16,279.52 2,897,756,196	18,705.00 3,329,490,000	0.91
22	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,448,300	1,770.86 2,564,742,405	1,964.50 2,845,185,350	0.78
23	KDDI	日本	株式	情報・通信業	667,000	4,702.50 3,136,568,564	4,254.00 2,837,418,000	0.77
24	三菱重工業	日本	株式	機械	1,597,000	908.12 1,450,269,710	1,723.00 2,751,631,000	0.75
25	ディスコ	日本	株式	機械	44,000	28,449.20 1,251,764,925	61,040.00 2,685,760,000	0.73
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	807,700	2,772.68 2,239,499,765	3,322.00 2,683,179,400	0.73
27	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,000,300	1,959.43 1,960,027,038	2,567.50 2,568,270,250	0.70
28	ダイキン工業	日本	株式	機械	109,000	24,628.75 2,684,533,779	22,370.00 2,438,330,000	0.66
29	丸紅	日本	株式	卸売業	793,500	2,521.44 2,000,763,435	2,975.50 2,361,059,250	0.64
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	541,000	3,456.67 1,870,063,846	4,348.00 2,352,268,000	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.29%
合計	97.29%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.33%
建設業	1.96%
食料品	2.97%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.14%
化学	5.47%
医薬品	4.24%
石油・石炭製品	0.53%
ゴム製品	0.63%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.85%
非鉄金属	0.75%
金属製品	0.50%
機械	5.57%
電気機器	17.31%
輸送用機器	8.10%
精密機器	2.16%
その他製品	2.38%
電気・ガス業	1.41%
陸運業	2.18%

海運業	0.72%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	6.84%
卸売業	7.41%
小売業	3.87%
銀行業	7.94%
証券、商品先物取引業	0.91%
保険業	3.14%
その他金融業	1.16%
不動産業	1.84%
サービス業	4.41%
合計	97.29%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0609月	買建	357	9,897,891,350	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) 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。

(2) 投資資産（2024年6月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	145 5年国債	日本	国債証券	1,770,000,000	100.17 1,773,026,700	99.88 1,767,946,800	0.100000 2025/09/20	1.44
2	148 5年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	99.65 1,594,556,400	99.37 1,589,968,000	0.005000 2026/06/20	1.29
3	150 5年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.62 1,494,364,000	99.15 1,487,310,000	0.005000 2026/12/20	1.21
4	147 5年国債	日本	国債証券	1,430,000,000	99.91 1,428,803,900	99.52 1,423,264,700	0.005000 2026/03/20	1.16
5	370 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	98.67 1,332,129,200	96.57 1,303,708,500	0.500000 2033/03/20	1.06
6	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.71 1,246,475,000	98.88 1,236,100,000	0.100000 2027/12/20	1.01
7	365 10年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	96.51 1,254,721,800	94.99 1,234,974,000	0.100000 2031/12/20	1.00
8	146 5年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.15 1,181,802,400	99.80 1,177,746,200	0.100000 2025/12/20	0.96
9	149 5年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	99.53 1,164,546,400	99.27 1,161,482,400	0.005000 2026/09/20	0.94
10	360 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	97.78 1,173,408,000	96.56 1,158,792,000	0.100000 2030/09/20	0.94
11	368 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	96.13 1,153,604,500	94.74 1,136,988,000	0.200000 2032/09/20	0.92
12	347 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	99.91 1,099,021,000	99.16 1,090,793,000	0.100000 2027/06/20	0.89
13	373 10年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	98.63 1,104,715,600	96.41 1,079,836,800	0.600000 2033/12/20	0.88
14	364 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.77 1,064,557,000	95.31 1,048,498,000	0.100000 2031/09/20	0.85
15	456 2年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.87 1,048,645,500	99.76 1,047,553,500	0.100000 2026/01/01	0.85
16	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.82 1,048,204,500	99.04 1,039,972,500	0.100000 2027/09/20	0.85
17	156 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	99.51 995,124,300	99.21 992,130,000	0.200000 2027/12/20	0.81
18	154 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	99.47 974,894,700	99.02 970,484,200	0.100000 2027/09/20	0.79
19	369 10年国債	日本	国債証券	990,000,000	98.96 979,707,700	96.85 958,824,900	0.500000 2032/12/20	0.78
20	363 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.20 972,036,000	95.66 956,620,000	0.100000 2031/06/20	0.78
21	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.04 950,427,500	99.39 944,290,500	0.100000 2026/12/20	0.77
22	455 2年国債	日本	国債証券	930,000,000	99.75 927,745,000	99.66 926,903,100	0.005000 2025/12/01	0.75

23	366 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	96.70 918,665,800	95.39 906,252,500	0.200000 2032/03/20	0.74
24	350 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.59 896,355,000	98.72 888,480,000	0.100000 2028/03/20	0.72
25	372 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.46 904,213,800	98.51 886,671,000	0.800000 2033/09/20	0.72
26	161 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	99.68 877,250,000	99.29 873,822,400	0.300000 2028/06/20	0.71
27	371 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	97.37 876,359,000	95.37 858,375,000	0.400000 2033/06/20	0.70
28	367 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	96.94 872,487,000	95.07 855,693,000	0.200000 2032/06/20	0.70
29	163 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.46 853,963,800	99.54 846,132,500	0.400000 2028/09/20	0.69
30	151 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	99.66 847,181,000	99.03 841,763,500	0.005000 2027/03/20	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	83.30%
地方債証券	5.66%
特殊債券	3.20%
社債券	7.26%
合計	99.41%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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。

(2) 投資資産 (2024年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	403,400	61,725.56 24,900,112,662	72,940.54 29,424,217,668	4.88
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	838,200	30,351.70 25,440,827,068	34,485.08 28,905,399,923	4.79
3	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,429,800	8,671.68 12,398,987,235	19,971.06 28,554,634,885	4.73
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	535,200	24,219.12 12,962,134,021	31,867.69 17,055,592,772	2.83
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	125,200	56,170.74 7,032,580,516	83,685.52 10,477,428,256	1.74
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	336,700	22,039.36 7,420,693,821	29,863.98 10,055,204,995	1.67
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	291,540	22,232.65 6,481,723,693	30,097.54 8,774,636,870	1.45
8	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	46,185	98,762.64 4,561,355,520	146,419.07 6,762,364,877	1.12
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	25,212	158,066.84 3,985,184,753	255,563.32 6,443,262,580	1.07
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	164,070	25,479.50 4,180,437,743	32,080.31 5,263,416,773	0.87
11	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	163,850	38,059.87 6,236,124,640	31,798.43 5,210,174,296	0.86
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	74,950	58,731.43 4,401,928,338	65,708.50 4,924,852,562	0.82
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	256,209	16,591.82 4,250,975,660	18,506.94 4,741,645,359	0.79
14	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	197,487	16,477.41 3,254,078,091	23,160.06 4,573,810,769	0.76
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	52,766	85,375.15 4,504,910,404	78,350.89 4,134,263,104	0.69
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	90,450	41,334.26 3,738,694,264	42,939.65 3,883,891,460	0.64
17	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	22,151	113,147.74 2,506,338,420	165,436.80 3,664,590,557	0.61
18	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	134,467	24,517.43 3,296,803,424	26,837.48 3,608,755,880	0.60

19	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	25,360	97,801.38 2,480,244,223	137,009.36 3,474,557,456	0.58
20	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	47,600	67,005.92 3,189,486,718	71,313.74 3,394,534,143	0.56
21	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	137,800	24,523.39 3,379,331,068	23,484.00 3,236,096,027	0.54
22	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	56,650	50,942.89 2,885,917,444	55,003.79 3,115,964,947	0.52
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	144,721	16,763.52 2,426,054,497	20,910.10 3,026,131,653	0.50
24	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	253,300	8,544.44 2,164,331,254	10,933.43 2,769,438,224	0.46
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	101,272	22,936.52 2,322,832,670	27,219.21 2,756,544,777	0.46
26	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	24,790	79,080.53 1,960,408,274	110,226.64 2,732,518,500	0.45
27	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	405,801	4,990.43 2,025,181,803	6,321.99 2,565,472,907	0.43
28	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	100,218	23,339.04 2,338,998,522	25,178.46 2,523,335,145	0.42
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	234,050	9,417.27 2,204,136,402	10,293.98 2,409,306,885	0.40
30	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ	株式	情報技術	92,427	20,942.32 1,935,643,576	25,685.83 2,374,064,477	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.29%
投資証券	1.79%
合計	95.08%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.18%
素材	3.38%
資本財・サービス	9.41%
一般消費財・サービス	9.31%
生活必需品	6.06%
ヘルスケア	11.42%
金融	13.91%
情報技術	25.40%
コミュニケーション・サービス	7.57%
公益事業	2.40%
不動産	0.26%
合計	93.29%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI SEP 24	買建	432	19,296,331,317	19,295,155,152	3.20%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 24	買建	92	1,539,975,912	1,538,797,152	0.26%
	オーストラ リア	SPI 200 SEP 24	買建	59	1,227,195,359	1,222,985,925	0.20%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 24	買建	72	2,190,826,822	2,225,325,053	0.37%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 24	買建	76	1,642,920,513	1,640,739,619	0.27%
		EURO STOXX 50 SEP 24	買建	440	3,746,193,982	3,744,248,376	0.62%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2024年7月	買建	7,400,000	773,089,480	791,098,480	0.13%
		英ポンド買/円売 2024年7月	買建	3,400,000	679,634,130	691,118,000	0.11%
		カナダ・ドル買/円売 2024年7月	買建	13,700,000	1,575,361,940	1,607,200,430	0.27%
		ユーロ買/円売 2024年7月	買建	9,500,000	1,615,320,970	1,635,890,500	0.27%
		米ドル買/円売 2024年7月	買建	50,300,000	7,894,196,630	8,093,189,520	1.34%
		スイス・フラン買/円売 2024年7月	買建	6,400,000	1,117,623,360	1,145,773,440	0.19%

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

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

(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。

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

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 ニューゼーランド	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。

(2) 投資資産 (2024年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	96.47 1,709,372,648	96.79 1,715,002,489	3.875000 2033/08/15	0.52
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	103.33 1,664,372,864	101.55 1,635,730,278	4.500000 2033/11/15	0.50
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	99.49 1,600,235,894	100.16 1,610,989,766	2.050000 2029/04/15	0.49
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,543,208,609	98.84 1,544,271,027	4.125000 2032/11/15	0.47
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,397,165,635	82.08 1,414,762,049	1.125000 2031/02/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,359,811,730	89.45 1,368,839,704	2.750000 2032/08/15	0.41
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,348,770,059	90.56 1,356,544,425	2.875000 2032/05/15	0.41
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,333,720,162	81.51 1,352,317,787	1.250000 2031/08/15	0.41
9	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,319,265,352	101.37 1,340,216,186	2.390000 2026/11/15	0.41
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,298,594,661	81.71 1,316,231,826	1.375000 2031/11/15	0.40
11	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	100.69 1,286,790,193	101.64 1,298,903,243	2.370000 2029/01/15	0.39
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	97.98 1,294,219,545	97.71 1,290,528,275	4.000000 2034/02/15	0.39
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,261,699,644	81.17 1,281,336,010	0.875000 2030/11/15	0.39

14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,212,045,307	94.25 1,214,583,770	3.500000 2033/02/15	0.37
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,168,005,064	84.27 1,180,953,159	1.625000 2031/05/15	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,162,434,740	94.41 1,175,319,559	1.625000 2026/05/15	0.36
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,168,791,247	93.24 1,171,417,010	3.375000 2033/05/15	0.35
18	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	100.79 1,110,446,206	102.60 1,130,309,046	2.540000 2030/12/25	0.34
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 1,027,312,513	92.30 1,040,673,270	1.125000 2026/10/31	0.32
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 1,016,222,844	80.41 1,036,131,096	0.625000 2030/08/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 1,015,066,361	94.33 1,018,001,701	2.875000 2028/08/15	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 976,068,093	87.89 991,041,160	0.750000 2028/01/31	0.30
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 987,299,504	94.59 990,388,021	2.875000 2028/05/15	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 981,546,405	92.86 987,170,003	2.625000 2029/02/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	102.17 987,435,801	102.04 986,154,296	4.875000 2028/10/31	0.30
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 965,987,043	94.23 971,450,538	2.375000 2027/05/15	0.29
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 959,021,249	92.57 969,208,121	1.500000 2027/01/31	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 962,122,330	94.39 965,497,552	2.750000 2028/02/15	0.29
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 964,487,160	99.35 960,147,934	4.375000 2026/08/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.44 961,096,074	99.05 957,258,338	4.250000 2026/01/31	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.53%
合計	97.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	メキシコ・ペソ買/円売 2024年7月	買建	16,255,000	148,292,739	141,363,233	0.04%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2024年7月	買建	814,000	12,131,042	12,265,921	0.00%
		オフショア人民元買/円売 2024年7月	買建	36,748,000	793,662,789	809,176,732	0.25%
		シンガポール・ドル買/円 売 2024年7月	買建	448,000	51,914,150	53,045,081	0.02%
		米ドル買/円売 2024年7月	買建	5,408,000	852,484,555	870,336,019	0.26%
		ユーロ買/円売 2024年7月	買建	1,940,000	330,885,760	334,150,547	0.10%
		カナダ・ドル買/円売 2024年7月	買建	1,585,000	182,112,685	185,947,763	0.06%
		英ポンド買/円売 2024年7 月	買建	204,000	41,243,497	41,488,560	0.01%
		豪ドル買/円売 2024年7月	買建	224,000	23,713,800	23,952,943	0.01%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2024年7月	買建	160,000	15,374,640	15,634,944	0.00%

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,147,793	6.1147 7,018,416	6.8497 7,862,037	30.53
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,291,121	1.3297 7,035,845	1.3093 6,927,664	26.90
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,946,306	1.9346 5,699,935	2.0425 6,017,830	23.37
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,212,484	3.5954 4,359,457	3.7995 4,606,832	17.89

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.69%
合計	98.69%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,665,940	6.1307 10,213,431	6.8497 11,411,189	45.42
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,176,182	1.9382 8,094,654	2.0425 8,529,851	33.95

3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,104,955	3.5970 3,974,584	3.7995 4,198,276	16.71
4	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	560,787	1.3299 745,800	1.3093 734,238	2.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

（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。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)

1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,506,922	1.3321 2,007,448	1.3093 1,973,012	59.46
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	80,655	5.7964 467,516	6.8497 552,462	16.65
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	209,678	1.8545 388,867	2.0425 428,267	12.91
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	42,148	3.2231 135,848	3.1723 133,706	4.03
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	28,630	3.5233 100,874	3.7995 108,779	3.28
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	22,006	3.5244 77,558	3.8936 85,682	2.58

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.90%
合計	98.90%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

(2) 投資資産 (2024年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	36,806	584,034.27 21,495,965,565	563,000.00 20,721,778,000	6.46
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	32,409	532,950.05 17,272,378,273	508,000.00 16,463,772,000	5.13
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	102,029	140,741.00 14,359,664,008	142,700.00 14,559,538,300	4.54
4	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	89,403	147,365.68 13,174,934,114	156,500.00 13,991,569,500	4.36
5	GLP投資法人	日本	投資証券	105,978	122,259.44 12,956,811,597	131,300.00 13,914,911,400	4.33
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	54,963	257,330.82 14,143,674,092	251,000.00 13,795,713,000	4.30
7	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	151,231	90,913.22 13,748,897,886	90,500.00 13,686,405,500	4.26
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	47,559	246,249.90 11,711,399,364	245,800.00 11,690,002,200	3.64
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	30,955	318,080.53 9,846,182,925	327,500.00 10,137,762,500	3.16
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	70,577	146,011.20 10,305,032,702	142,900.00 10,085,453,300	3.14
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	62,865	158,526.29 9,965,755,236	159,200.00 10,008,108,000	3.12
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	152,761	65,715.26 10,038,730,222	65,200.00 9,960,017,200	3.10
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	105,617	77,210.84 8,154,777,424	77,700.00 8,206,440,900	2.56
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	94,807	76,628.45 7,264,913,693	79,100.00 7,499,233,700	2.34
15	産業ファンド	日本	投資証券	57,467	131,185.04 7,538,810,934	126,600.00 7,275,322,200	2.27
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	21,577	319,591.53 6,895,826,549	324,000.00 6,990,948,000	2.18
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	10,894	591,378.70 6,442,479,668	639,000.00 6,961,266,000	2.17

18	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	40,331	150,607.94 6,074,168,935	147,600.00 5,952,855,600	1.85
19	API投資法人	日本	投資証券	16,238	380,521.39 6,178,906,385	365,000.00 5,926,870,000	1.85
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	13,123	442,991.35 5,813,375,520	433,500.00 5,688,820,500	1.77
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	20,139	264,852.65 5,333,867,614	266,000.00 5,356,974,000	1.67
22	イオンリート投資	日本	投資証券	38,702	135,299.33 5,236,354,989	133,200.00 5,155,106,400	1.61
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	11,706	435,620.22 5,099,370,300	439,500.00 5,144,787,000	1.60
24	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	15,515	292,713.71 4,541,453,290	318,000.00 4,933,770,000	1.54
25	森ヒルズリート	日本	投資証券	37,101	134,794.56 5,001,013,331	131,600.00 4,882,491,600	1.52
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	46,462	102,224.29 4,749,544,988	105,000.00 4,878,510,000	1.52
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	29,519	145,319.80 4,289,695,427	146,000.00 4,309,774,000	1.34
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	60,815	70,206.37 4,269,600,418	69,400.00 4,220,561,000	1.31
29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	10,895	363,161.94 3,956,649,379	381,000.00 4,150,995,000	1.29
30	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	31,988	117,911.63 3,771,757,408	116,300.00 3,720,204,400	1.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.02%
合計	97.02%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	TREIT 先物 0609月	買建	5,600	9,520,616,000	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) 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。

(2) 投資資産（2024年6月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	173,337	18,314.46 3,174,587,367	17,935.14 3,108,824,142	7.27
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	17,706	130,290.97 2,306,932,043	121,118.19 2,144,518,800	5.01
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	111,935	14,436.38 1,615,946,063	16,646.58 1,863,335,436	4.35
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	61,030	20,055.14 1,223,975,495	24,129.89 1,472,647,596	3.44
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	60,704	22,371.65 1,358,051,165	23,954.33 1,454,123,673	3.40
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	163,016	8,638.66 1,408,249,055	8,444.90 1,376,653,835	3.22
7	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	29,603	41,800.24 1,237,417,263	46,154.60 1,366,314,875	3.19
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	341,947	2,549.27 871,719,972	3,689.36 1,261,565,584	2.95
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	76,300	13,358.50 1,019,265,392	13,550.81 1,033,927,497	2.42
10	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	39,621	21,050.39 834,038,406	25,085.04 993,894,441	2.32
11	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	195,300	4,763.80 930,385,909	4,579.22 894,321,686	2.09
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	26,497	27,704.68 734,093,197	33,228.74 880,461,950	2.06
13	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	54,813	10,390.14 569,518,915	14,369.05 787,610,995	1.84
14	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	64,557	9,194.35 593,568,170	11,002.69 710,300,768	1.66
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	75,745	7,318.85 554,367,049	8,183.96 619,894,558	1.45
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	107,825	5,330.12 574,737,715	5,692.21 613,762,953	1.43
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	29,460	17,714.80 521,882,239	18,746.93 552,284,773	1.29
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,967	34,550.80 413,470,847	44,033.31 526,946,700	1.23
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	21,791	20,049.02 436,889,048	22,636.77 493,278,025	1.15
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	257,696	1,686.84 434,707,019	1,817.48 468,358,192	1.09
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	23,307	20,598.43 480,088,141	19,338.06 450,712,262	1.05
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	131,740	2,772.17 365,220,125	3,098.98 408,260,521	0.95
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	124,985	3,062.42 382,760,890	3,074.82 384,307,165	0.90
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	131,986	2,834.99 374,195,092	2,902.48 383,086,910	0.90

25	UDR INC	アメリカ	投資証券	56,660	5,416.46 306,902,646	6,566.82 372,076,242	0.87
26	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	40,976	9,958.79 408,075,725	8,963.54 367,290,240	0.86
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	34,866	11,234.47 391,702,636	10,511.42 366,491,456	0.86
28	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	50,836	7,378.45 375,096,023	7,198.21 365,928,625	0.86
29	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	60,189	5,769.36 347,256,581	5,920.93 356,375,048	0.83
30	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	19,868	14,570.71 289,491,433	17,675.82 351,183,228	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	2.42%
投資証券	94.90%
合計	97.32%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 24	買建	160	869,600,179	868,231,728	2.03%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 24	買建	270	295,337,879	294,529,203	0.69%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2024年7月	買建	620,000	105,419,716	106,763,380	0.25%
		米ドル買/円売 2024年7月	買建	1,320,000	206,470,440	212,385,888	0.50%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,116,759	6.1356 12,987,753	6.8497 14,499,164	28.31
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,874,917	1.3300 14,464,444	1.3093 14,238,528	27.80
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,385,337	1.9373 10,433,082	2.0425 10,999,550	21.48
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,336,716	3.2138 4,295,979	3.1723 4,240,464	8.28
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	921,339	3.6469 3,360,100	3.8936 3,587,325	7.00
6	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	827,163	3.5998 2,977,659	3.7995 3,142,805	6.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,570,318	6.1144 15,716,049	6.8497 17,605,907	45.23
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,404,902	1.9337 12,385,661	2.0425 13,082,012	33.61
3	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	805,848	3.6392 2,932,700	3.8936 3,137,649	8.06
4	ダイワJ - REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	750,191	3.2165 2,413,059	3.1723 2,379,830	6.11
5	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	902,073	1.3300 1,199,778	1.3093 1,181,084	3.03
6	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	303,245	3.5942 1,089,940	3.7995 1,152,179	2.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,964,262	1.3315 2,615,481	1.3093 2,571,808	59.07
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	95,216	5.8668 558,619	6.8497 652,201	14.98
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	274,966	1.8753 515,670	2.0425 561,618	12.90
4	ダイワ・REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	48,155	3.2157 154,854	3.1723 152,762	3.51
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	37,268	3.5382 131,864	3.7995 141,599	3.25
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,085	3.5385 81,688	3.8936 89,883	2.06
7	新興国株式インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	64,366	1.0579 68,094	1.2058 77,612	1.78
8	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	30,677	1.8247 55,979	1.9232 58,998	1.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.91%
合計	98.91%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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。

(2) 投資資産（2024年6月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	投資証券	5,095	8,032.56 40,926,172	8,601.13 43,822,798	83.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	83.09%
合計	83.09%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) SEP 24	買建	1	8,727,497	8,747,712	16.59%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年7月	買建	18,500	2,893,714	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) 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。

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ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。

(2) 投資資産 (2024年6月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	32,000,000	75.64 708,336,273	80.29 751,889,001	- 2026/07/01	1.53
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	29,700,000	79.54 691,262,371	84.99 738,692,827	- 2026/01/01	1.50
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	66,150,000	103.86 599,127,398	103.53 597,190,028	10.500000 2026/12/21	1.21
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	20,800,000	98.09 597,039,066	93.37 568,306,882	10.000000 2029/01/01	1.15
5	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	19,650,000	99.61 572,791,586	96.51 554,963,583	10.000000 2027/01/01	1.13
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	85,520,000	71.93 536,408,983	73.79 550,277,413	8.750000 2048/02/28	1.12
7	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	67,200,000	88.82 520,494,326	91.33 535,220,206	8.000000 2030/01/31	1.09
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	64,200,000	83.73 468,751,810	86.59 484,751,601	8.250000 2032/03/31	0.98
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	56,400,000	91.48 449,788,310	92.62 455,391,501	5.750000 2026/03/05	0.92
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	61,700,000	82.42 443,474,391	83.90 451,402,136	8.875000 2035/02/28	0.92
11	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	16,300,000	82.67 394,326,082	90.09 429,735,460	- 2025/07/01	0.87
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	55,350,000	94.73 457,108,864	88.99 429,427,375	7.750000 2031/05/29	0.87
13	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	53,000,000	88.58 409,288,982	89.04 411,389,187	5.500000 2027/03/04	0.83
14	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	104.24 412,349,933	102.46 405,312,324	6.000000 2033/10/25	0.82
15	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	108.52 407,616,399	107.52 403,865,885	7.500000 2028/07/25	0.82

16	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	76.08 390,093,077	77.94 399,626,438	8.500000 2037/01/31	0.81
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,030,000	95.04 397,933,271	93.00 389,400,512	7.500000 2027/06/03	0.79
18	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	86.28 374,073,361	87.75 380,446,326	2.750000 2029/10/25	0.77
19	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,190,000	91.82 337,170,610	95.03 348,979,580	2.500000 2026/07/25	0.71
20	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	98.49 353,974,559	96.07 345,264,727	6.375000 2032/04/15	0.70
21	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,620,000	87.40 370,457,278	80.56 341,458,209	7.750000 2042/11/13	0.69
22	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	45,400,000	90.31 357,433,719	85.72 339,289,629	7.500000 2033/05/26	0.69
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	76.42 329,208,149	78.00 335,999,040	9.000000 2040/01/31	0.68
24	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,230,000	98.41 345,145,825	94.01 329,722,068	8.500000 2029/05/31	0.67
25	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	73.22 304,556,969	74.04 307,964,937	8.750000 2044/01/31	0.62
26	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	14,700,000	70.81 304,584,313	71.39 307,077,738	- 2027/07/01	0.62
27	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	42,500,000	85.78 317,826,492	80.55 298,429,292	8.000000 2053/07/31	0.61
28	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,400,000	75.80 284,714,249	77.71 291,904,813	1.250000 2030/10/25	0.59
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	26,920,000,000	113.69 302,993,159	109.01 290,544,356	8.375000 2034/03/15	0.59
30	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	66,500,000	96.73 281,121,623	95.97 278,911,054	2.000000 2031/12/17	0.57

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.95%
合計	94.95%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ハンガリー・フォリント 買/円売 2024年7月	買建	130,000,000	55,664,161	56,380,480	0.11%

メキシコ・ペソ買/円売 2024年7月	買建	3,000,000	25,805,100	26,063,100	0.05%
オフショア人民元買/円売 2024年7月	買建	2,600,000	56,006,090	57,234,060	0.12%
トルコ・リラ買/円売 2024年7月	買建	8,000,000	36,829,200	38,676,800	0.08%
ルーマニア・レイ買/円売 2024年7月	買建	6,000,000	203,589,200	207,324,000	0.42%
南アフリカ・ランド買/円売 2024年7月	買建	3,800,000	31,818,778	33,062,280	0.07%
ポーランド・ズロチ買/円売 2024年7月	買建	1,600,000	62,266,492	63,815,040	0.13%
チェコ・コルナ買/円売 2024年7月	買建	10,000,000	68,076,560	68,686,000	0.14%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,371,551	1.3296 11,131,581	1.3093 10,960,871	26.16
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,520,027	6.1421 9,336,299	6.8497 10,411,728	24.85
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,348,646	1.9383 8,429,107	2.0425 8,882,109	21.20
4	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	978,184	3.2153 3,145,166	3.1723 3,103,093	7.41
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	808,576	3.6003 2,911,196	3.7995 3,072,184	7.33
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	605,519	3.6411 2,204,784	3.8936 2,357,648	5.63
7	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	729,011	1.8577 1,354,340	1.9232 1,402,033	3.35

8	新興国株式インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,068,098	1.0960 1,170,655	1.2058 1,287,912	3.07
---	---------------------	----	-----------	-----------	---------------------	---------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.00%
合計	99.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

（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 - R E I T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R E I T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。

【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) 【投資資産】（2024年6月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,660,873	6.1545 28,685,551	6.8497 31,925,581	43.63
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,775,940	1.9419 24,810,525	2.0425 26,094,857	35.66
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	891,201	3.6039 3,211,885	3.7995 3,386,118	4.63
4	新興国株式インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,690,393	1.0982 2,954,800	1.2058 3,244,075	4.43
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	608,718	3.6516 2,222,800	3.8936 2,370,104	3.24
6	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,638,313	1.3292 2,177,777	1.3093 2,145,043	2.93
7	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	856,202	1.8605 1,593,035	1.9232 1,646,647	2.25
8	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	514,170	3.2082 1,649,573	3.1723 1,631,101	2.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	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。

(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 - R E I T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R E I T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。

[次へ](#)

（参考情報）運用実績

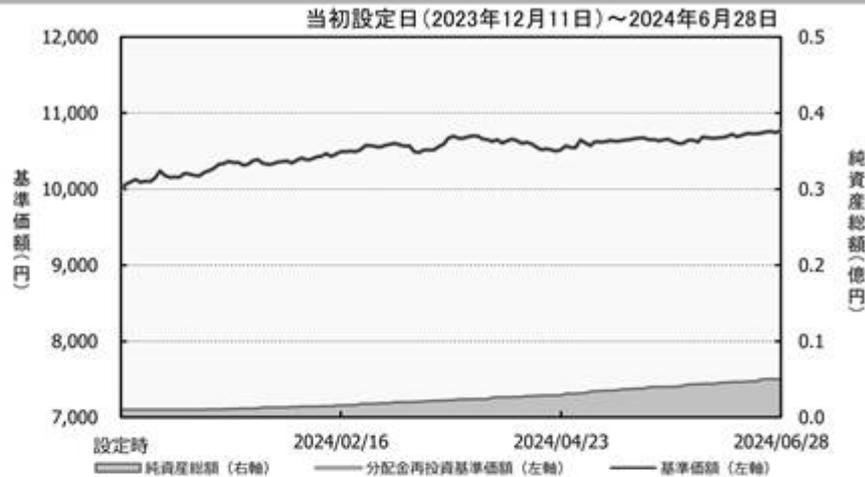
●スタイル9(4資産分散・保守型)

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

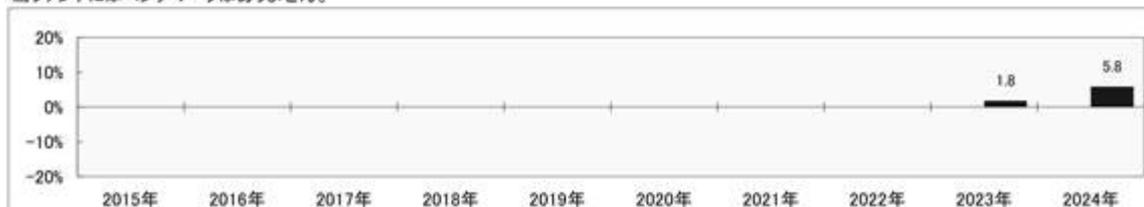
※比率は、純資産総額に対するものです。

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
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。

（参考情報）運用実績

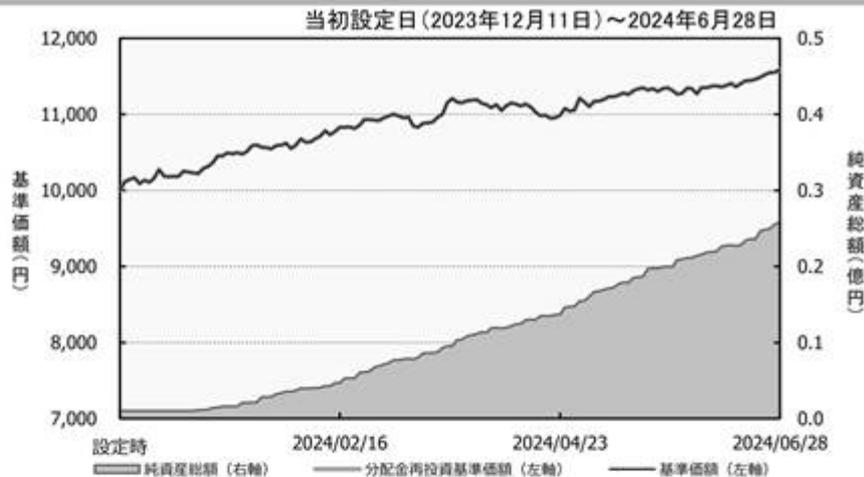
●スタイル9(4資産分散・バランス型)

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



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	3.5%
6カ月間	13.3%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	15.9%

※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。

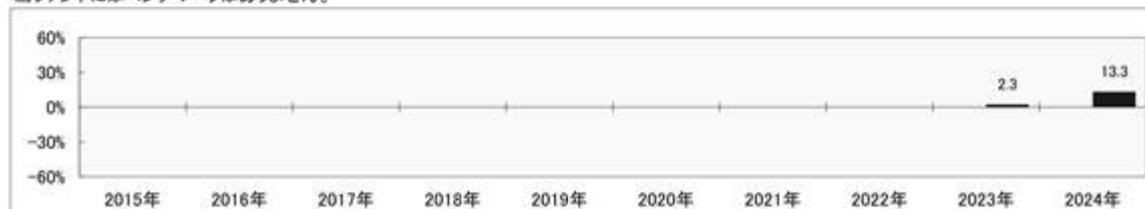
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	30.5%	外国株式・先物	1,178	30.0%	日本円	51.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
日本債券INDEXMF	26.9%	国内債券	424	26.7%	米ドル	31.9%	APPLE INC	アメリカ	1.5%
トピックス・インデックス・MF	23.4%	国内株式・先物	2,120	23.4%	ユーロ	8.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.4%
外国債券INDEXMF	17.9%	外国債券	1,003	17.4%	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。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(4資産分散・積極型)

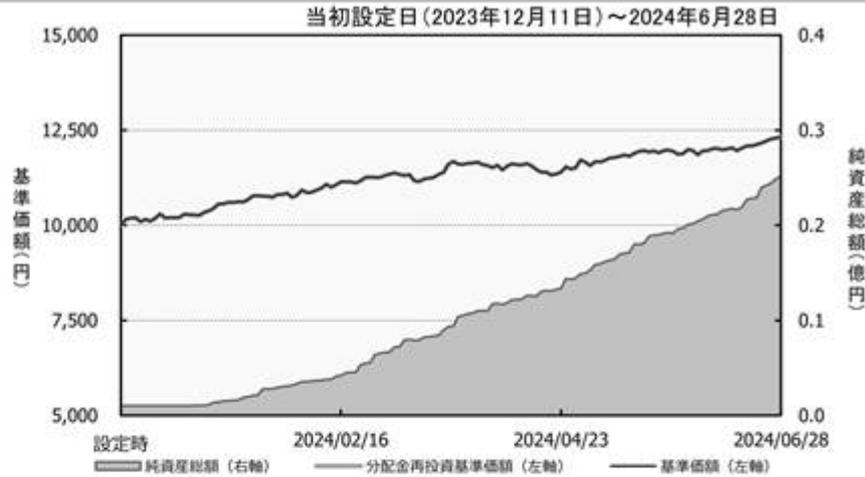
2024年6月28日現在

※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

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.7%
3カ月間	5.8%
6カ月間	20.0%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	23.3%



※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。

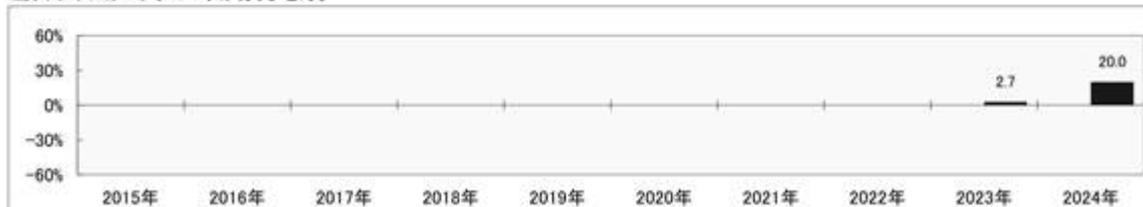
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.4%	外国株式・先物	1,178	44.6%	米ドル	42.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
トピックス・インデックス・MF	34.0%	国内株式・先物	2,120	34.0%	日本円	37.9%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
外国債券INDEXMF	16.7%	外国債券	1,003	16.3%	ユーロ	9.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.2%
日本債券INDEXMF	2.9%	国内債券	424	2.9%	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。

(参考情報) 運用実績

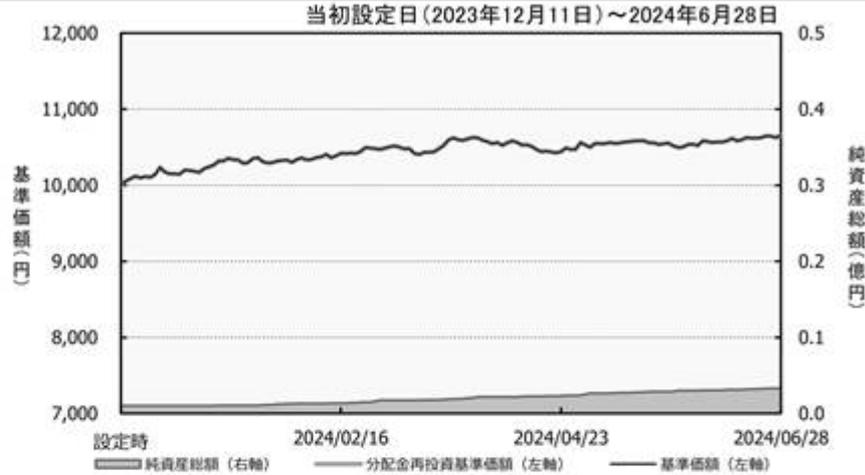
●スタイル9(6資産分散・保守型)

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)

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。

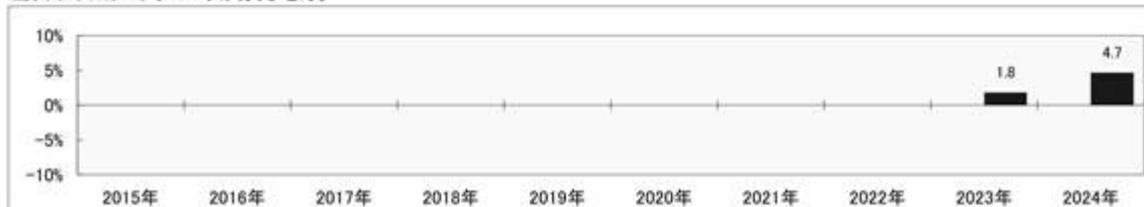
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.5%	国内債券	424	59.1%	日本円	77.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%
外国株式INDEXMF	16.6%	外国株式・先物	1,178	16.3%	米ドル	16.3%	APPLE INC	アメリカ	0.8%
トピックス・インデックス・MF	12.9%	国内株式・先物	2,120	12.9%	ユーロ	2.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	0.8%
ダイワJ-REIT MF	4.0%	国内リート・先物	59	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。

(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



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.5%
3カ月間	2.6%
6カ月間	11.1%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	13.8%

※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。

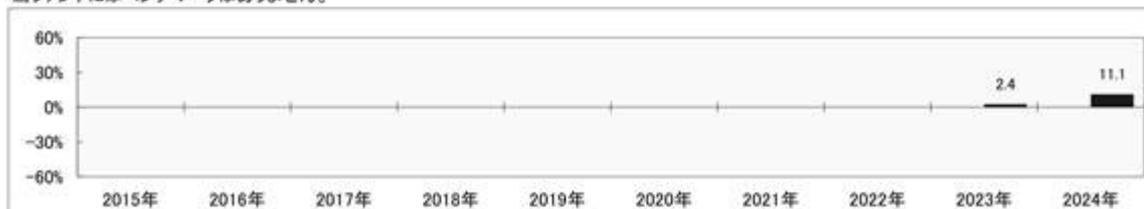
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	28.3%	外国株式・先物	1,178	27.8%	日本円	58.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.4%
日本債券INDEXMF	27.8%	国内債券	424	27.6%	米ドル	30.1%	APPLE INC	アメリカ	1.4%
トピックス・インデックス・MF	21.5%	国内株式・先物	2,120	21.5%	ユーロ	4.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.3%
ダイワJ-REIT MF	8.3%	国内リート・先物	59	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	89.0%	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。

(参考情報) 運用実績

●スタイル9(6資産分散・積極型)

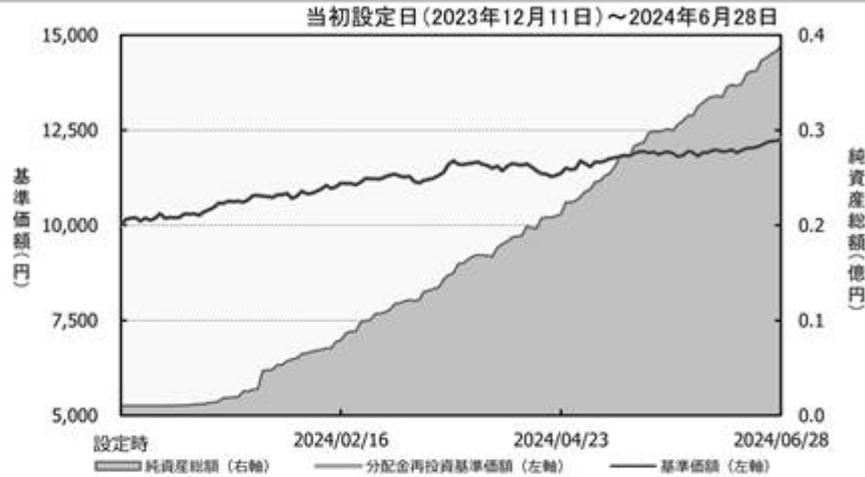
2024年6月28日現在

※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

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	5.1%
6カ月間	19.1%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	22.7%



※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年12月31日	0円
2024年3月31日	0円
2024年6月28日	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。

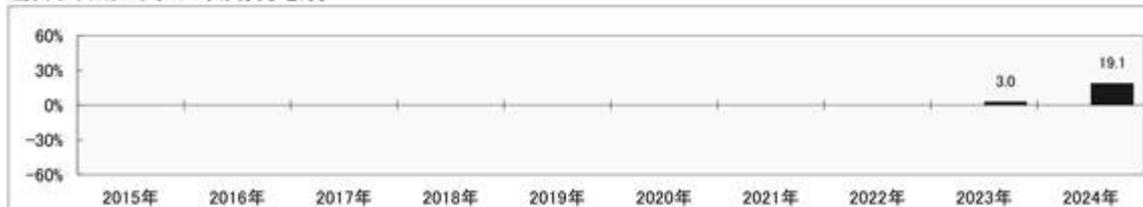
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	45.2%	外国株式・先物	1,178	44.4%	日本円	43.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.2%
トピックス・インデックス・MF	33.6%	国内株式・先物	2,120	33.6%	米ドル	42.4%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	8.1%	外国リート・先物	308	8.7%	ユーロ	5.2%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.1%
ダイワJ-REIT MF	6.1%	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。

(参考情報) 運用実績

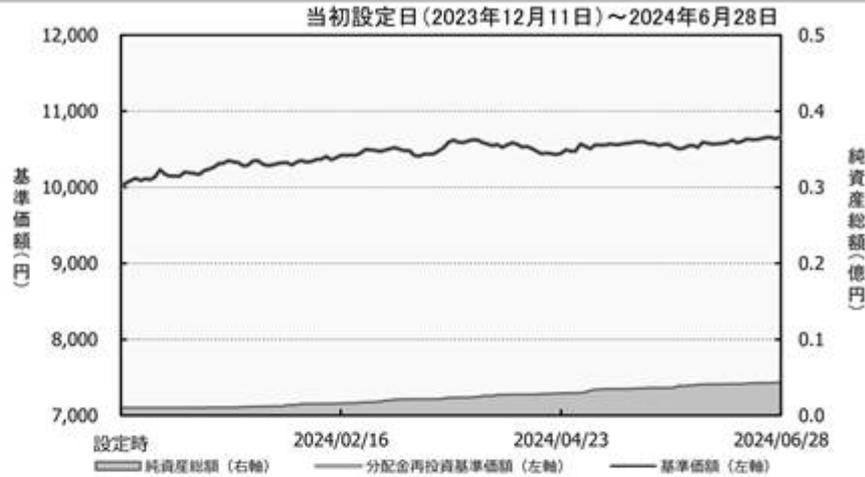
●スタイル9(8資産分散・保守型)

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)

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。

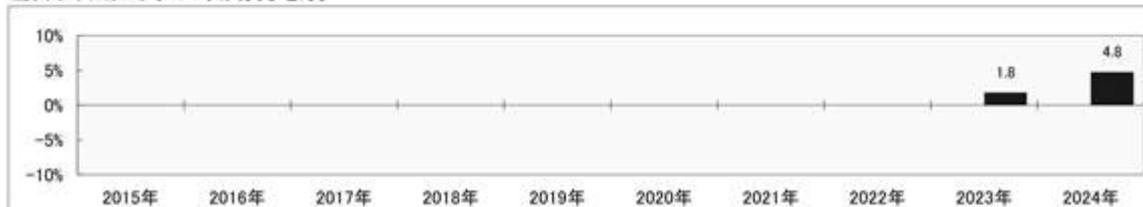
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	59.1%	国内債券	424	58.7%	日本円	76.6%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	1.5%
外国株式INDEXMF	15.0%	外国株式・先物	1,179	15.0%	米ドル	16.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
トピックス・インデックス・MF	12.9%	国内株式・先物	2,120	12.9%	ユーロ	2.4%	APPLE INC	アメリカ	0.7%
ダイワJ-REIT MF	3.5%	外国債券	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。

(参考情報) 運用実績

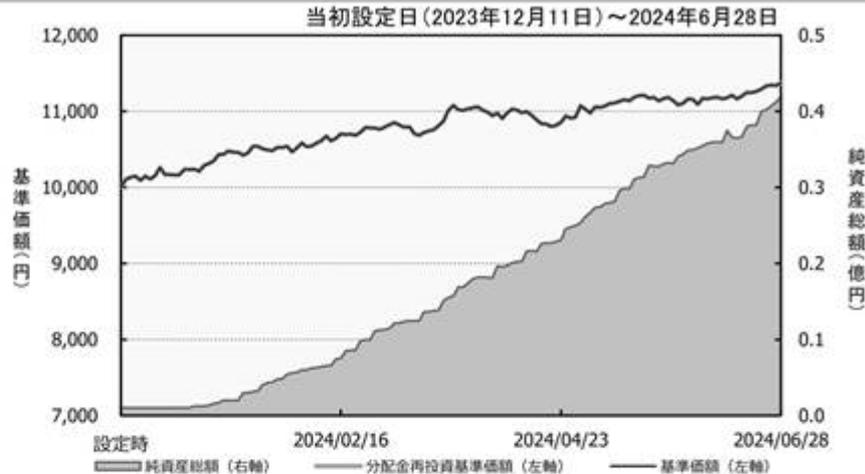
●スタイル9(8資産分散・バランス型)

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
分配金		

※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。

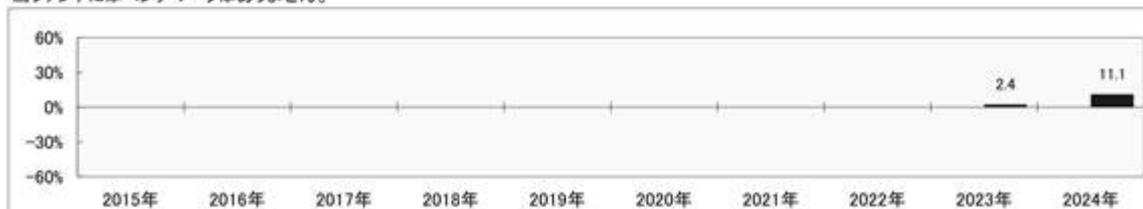
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
日本債券INDEXMF	26.2%	国内債券	424	26.0%	日本円	55.8%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	2.6%
外国株式INDEXMF	24.9%	外国株式・先物	1,179	24.9%	米ドル	30.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.2%
トピックス・インデックス・MF	21.2%	国内株式・先物	2,120	21.2%	ユーロ	4.6%	APPLE INC	アメリカ	1.2%
ダイワJ-REIT MF	7.4%	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 GCEI 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示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) 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

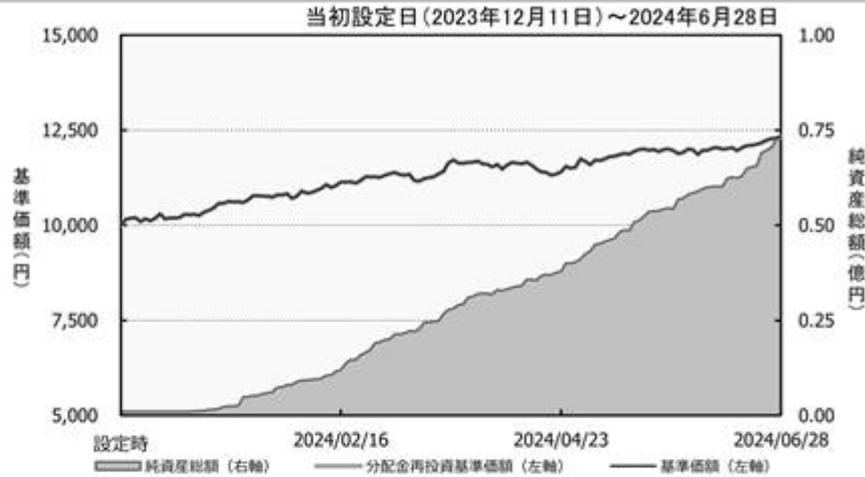
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

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)

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。

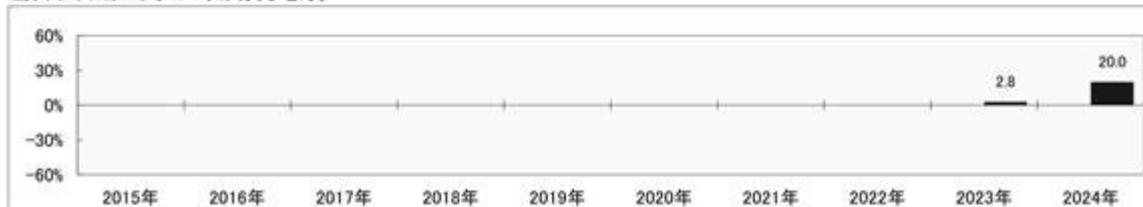
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
外国株式INDEXMF	43.6%	外国株式・先物	1,179	43.6%	米ドル	42.6%	ISHARES CORE MSCI EMERGING	アメリカ	3.7%
トピックス・インデックス・MF	35.7%	国内株式・先物	2,120	35.7%	日本円	41.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.1%
外国債券INDEXMF	4.6%	外国債券	1,216	6.7%	ユーロ	5.4%	APPLE INC	アメリカ	2.1%
新興国株式インデックスMF	4.4%	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。

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

< 訂正前 >

< 略 >

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

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

（2024年11月4日まで）

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

（2024年11月5日以降）

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

< 略 >

2 【換金（解約）手続等】

< 訂正前 >

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

< 略 >

< 訂正後 >

（2024年11月4日まで）

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

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行な

れる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、く
わしくは販売会社にお問合わせ下さい。

< 略 >

第3 【ファンドの経理状況】

1 【財務諸表】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【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】

	当中間計算期間末 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	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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	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	4,077,382,322円
A	
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスイン	907,970円
デックスファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般	9,102,808円
投資家私募)	
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般	139,851,291円
投資家私募)	
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般	11,667,234円
投資家私募)	
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般	344,658,301円
投資家私募)	
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	723,824,297円
格機関投資家専用)	
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	
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
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	(1)株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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>

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	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	762,944,628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 外国株式インデックス	5,182,149,127円
(為替ヘッジなし)	

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			
	契約額等	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	(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	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	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 エマージングプラス(為替ヘッジなし)	944,806,326円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	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 (円)	時価	評価損益 (円)
		うち 1年超 (円)	
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】

	当中間計算期間末 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	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	1	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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】

	当中間計算期間末 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	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	1	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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	1,2015円
（1万口当たり純資産額）	（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】

	当中間計算期間末 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	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	1	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「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」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 - R E I T 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

	<p>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

不動産投信関連

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				
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	<p>(1)投資信託受益証券</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。</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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	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
i F r e e 外国REITインデックス	653,160,526円

i F r e e 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	<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. 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	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】

	当中間計算期間末 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	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	1 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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額(円)
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」- 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（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】

	当中間計算期間末 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	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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	<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あります。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

(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」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「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」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】

	当中間計算期間末 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	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	1 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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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	1.0566円
(1万口当たり純資産額)	(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」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「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」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>

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	22,947,548,923円
期中追加設定元本額	2,830,207,137円
期中一部解約元本額	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）	556,551,931円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	459,751,982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）	548,456,659円
D - I ' s 新興国債券インデックス	66,260,648円
i F r e e 新興国債券インデックス	9,036,229,409円
i F r e e 8資産バランス	4,847,786,913円
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）	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	(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

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	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」- 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・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】

	当中間計算期間末 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	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	1 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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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】

	当中間計算期間末 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	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】

	当中間計算期間 自2023年12月11日 至2024年6月10日 金額（円）
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	1.2030円
(1万口当たり純資産額)	(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」- R E I Tマザーファンド」受益証券、「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」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。

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

スタイル9（4資産分散・保守型）

【純資産額計算書】

2024年6月28日

資産総額	5,086,965円
負債総額	44,850円
純資産総額（ - ）	5,042,115円
発行済数量	4,679,784口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0774円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	375,945,050,653円
負債総額	9,148,251,953円
純資産総額（ - ）	366,796,798,700円
発行済数量	179,584,595,744口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0425円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	123,053,990,926円
負債総額	99,022,578円
純資産総額（ - ）	122,954,968,348円
発行済数量	93,905,627,707口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3093円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	603,356,491,302円
------	------------------

負債総額	102,689,838円
純資産総額（ - ）	603,253,801,464円
発行済数量	88,070,056,690口
1単位当たり純資産額（ / ）	6.8497円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	330,399,983,257円
負債総額	141,091,190円
純資産総額（ - ）	330,258,892,067円
発行済数量	86,921,157,714口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.7995円

スタイル9（4資産分散・バランス型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	25,760,929円
負債総額	9,212円
純資産総額（ - ）	25,751,717円
発行済数量	22,219,350口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1590円

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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。

（参考）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。

スタイル9（4資産分散・積極型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	25,131,557円
負債総額	8,872円
純資産総額（ - ）	25,122,685円
発行済数量	20,374,041口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2331円

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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。

スタイル9（6資産分散・保守型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	3,319,698円
負債総額	1,243円
純資産総額（ - ）	3,318,455円
発行済数量	3,113,788口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0657円

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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）ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	322,484,114,675円
負債総額	1,469,505,000円
純資産総額（ - ）	321,014,609,675円

発行済数量	101,192,430,335口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.1723円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	42,900,304,628円
負債総額	110,675,832円
純資産総額（ - ）	42,789,628,796円
発行済数量	10,989,802,704口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.8936円

スタイル9（6資産分散・バランス型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	51,235,388円
負債総額	17,960円
純資産総額（ - ）	51,217,428円
発行済数量	45,015,869口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1378円

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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) 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。

(参考) 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。

スタイル9(6資産分散・積極型)

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	39,083,347円
負債総額	158,733円
純資産総額(-)	38,924,614円
発行済数量	31,734,715口
1単位当たり純資産額(/)	1.2266円

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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。

（参考）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）ダイワJ - R E I T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）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

前記「スタイル9（6資産分散・保守型）」の記載と同じ。

スタイル9（8資産分散・保守型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	4,355,368円
負債総額	1,646円
純資産総額（ - ）	4,353,722円
発行済数量	4,081,940口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0666円

（参考）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。

（参考）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。

(参考) 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。

(参考) 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) 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。

(参考) 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) 新興国株式インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	53,823,776円
負債総額	1,079,660円
純資産総額(-)	52,744,116円
発行済数量	43,740,652口
1単位当たり純資産額(/)	1.2058円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	49,323,946,136円
負債総額	21,490,339円
純資産総額(-)	49,302,455,797円

発行済数量	25,635,949,994口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.9232円

スタイル9（8資産分散・バランス型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	41,911,229円
負債総額	14,902円
純資産総額（ - ）	41,896,327円
発行済数量	36,833,739口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1374円

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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。

（参考）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）ダイワJ - R E I T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) 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) 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。

(参考) 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。

スタイル9（8資産分散・積極型）

純資産額計算書

2024年6月28日

資産総額	73,193,861円
負債総額	25,481円
純資産総額（ - ）	73,168,380円
発行済数量	59,306,692口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2337円

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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。

(参考) 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) 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。

(参考) 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) 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。

(参考) 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。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況および 2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年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 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

3 委託会社等の経理状況

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

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

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	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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いません。

（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%

5 【その他】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

5 その他

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2024年5月15日、株式会社かんぼ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、かんぼ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。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 訂正前 >

	名 称	資本金の額 (2023年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
投資顧問会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

< 略 >

< 訂正後 >

	名 称	資本金の額 (2024年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	株式会社SBI証券	54,323百万円	(注1)	
	木村証券株式会社	500百万円	(注1)	
	静岡東海証券株式会社	600百万円	(注1)	
投資顧問会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

< 略 >

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、継続企業の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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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、継続企業の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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

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。