

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2025年2月4日提出
【計算期間】	第38特定期間 (自 2024年5月11日 至 2024年11月11日)
【ファンド名】	安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹 優子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

2. インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

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

3. 成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

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

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

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

各ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

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

< 信託金の限度額 >

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

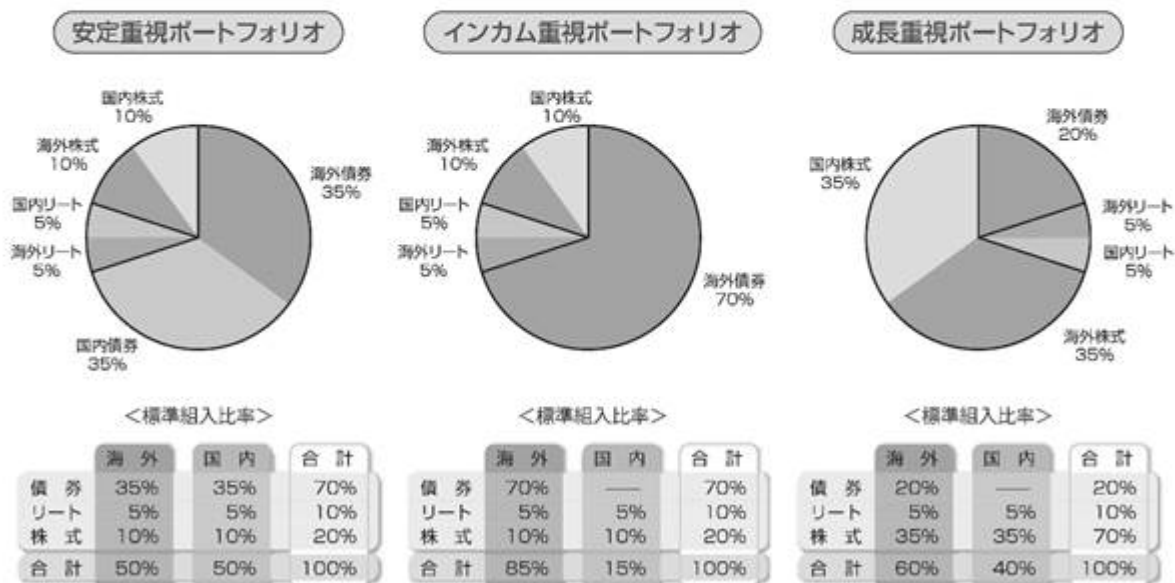
< ファンドの特色 >

1 内外の債券、リートおよび株式に投資します^(注)。

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

資産配分のイメージ

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

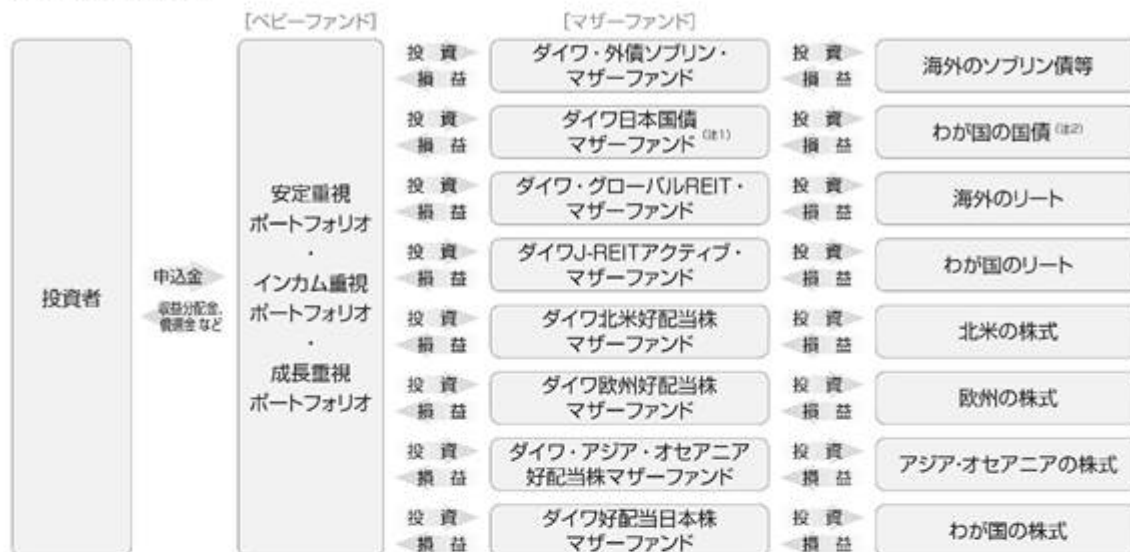


※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。
 ※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

(注2) 「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「わが国の国債」を除きます。

2 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて

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

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

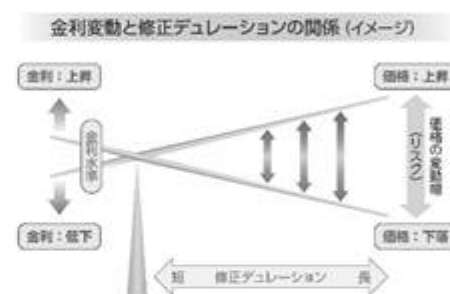
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

修正デュレーションについて

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

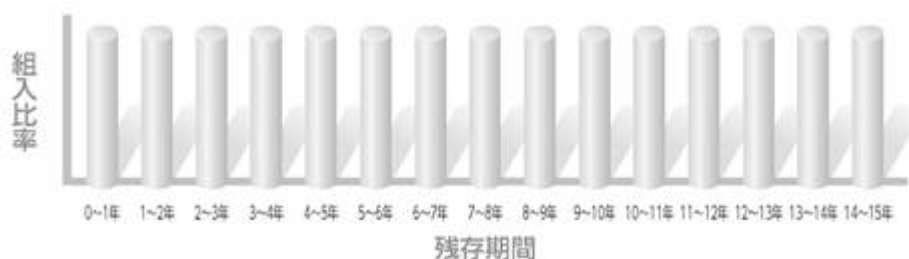


- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

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

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

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

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

4

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

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

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

海外のリーートの投資対象地域 (イメージ)



投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

5

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

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成 (イメージ)



投資対象のイメージ



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

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

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

※ハイブリッド優先証券とは…

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

〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・イングについて〉

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

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

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

6

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

投資対象のイメージ



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

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

銘柄選定プロセス



定量・定性分析による銘柄選定

予想配当利回り、
成長性、企業のファンダメンタルズ、
株価の割安性 等

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

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

7

毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11月）の各10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

〔安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ〕

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

〔インカム重視ポートフォリオ〕

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

収益分配のイメージ



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

[収益分配金に関する留意事項]

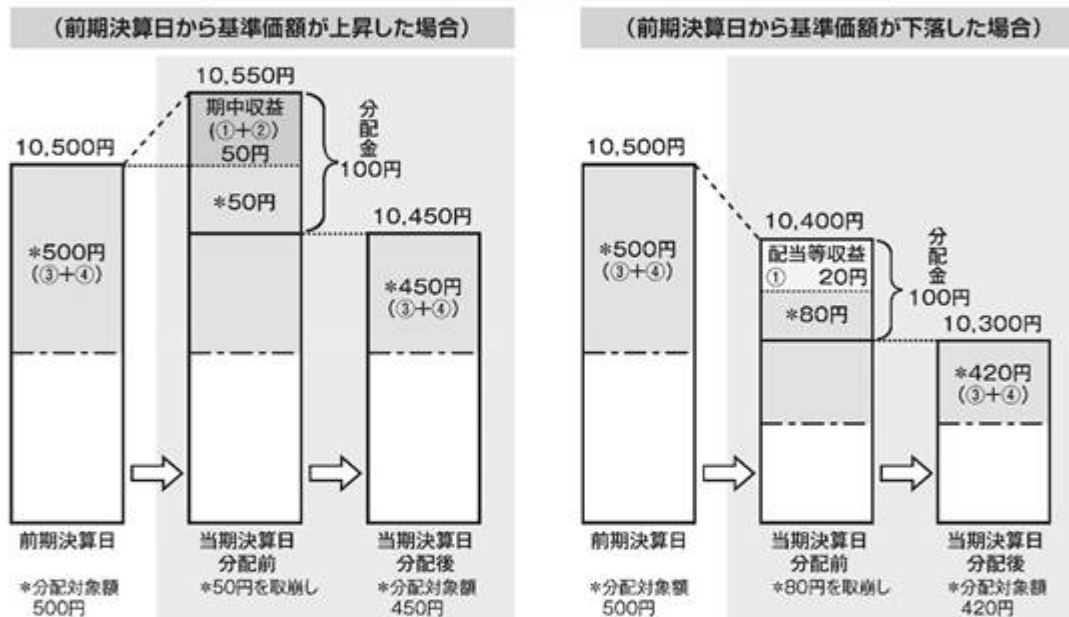
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が
支払われるイメージ



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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



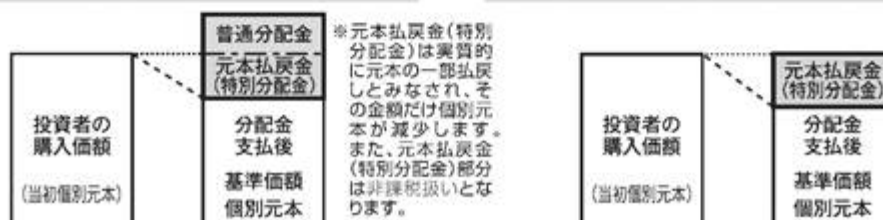
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005年11月14日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

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

1

収益分配金、償還金など お申込金(5)

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

運用指図

2

損益 信託金(5)

受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
------	---	--

損益 投資

投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないません。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します(カッコ内は投資顧問会社名)。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク) ・ダイワ北米好配当株マザーファンド(コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク) ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド(アムンディ・アイルランド・リミテッド)
------	---

(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

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

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

< 委託会社の概況(2024年11月末日現在) >

・ 資本金の額 414億2,454万1,896円

・ 沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号: 関東財務局長(金商)第352号)
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日	株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携

・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 80.00
株式会社かんぼ生命保険	東京都千代田区大手町二丁目3番1号	株 652,132	% 20.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券(安定重視ポートフォリオのみ)
3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

投資態度

<安定重視ポートフォリオ>

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

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

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

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

<インカム重視ポートフォリオ>

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

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の70%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

<成長重視ポートフォリオ>

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

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の20%

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

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

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

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

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

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

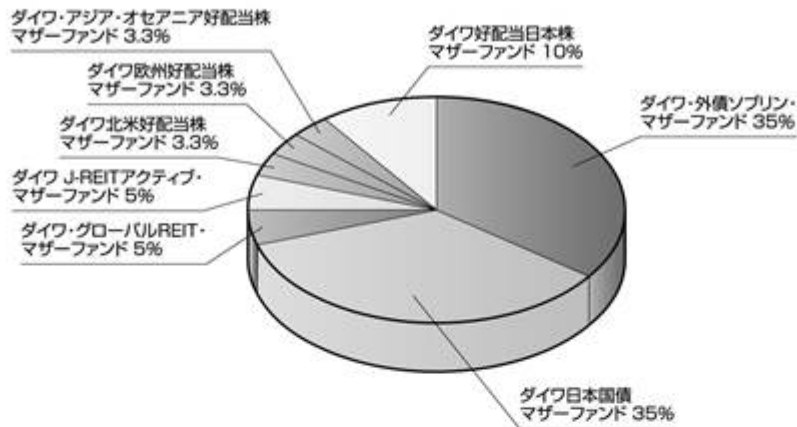
ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

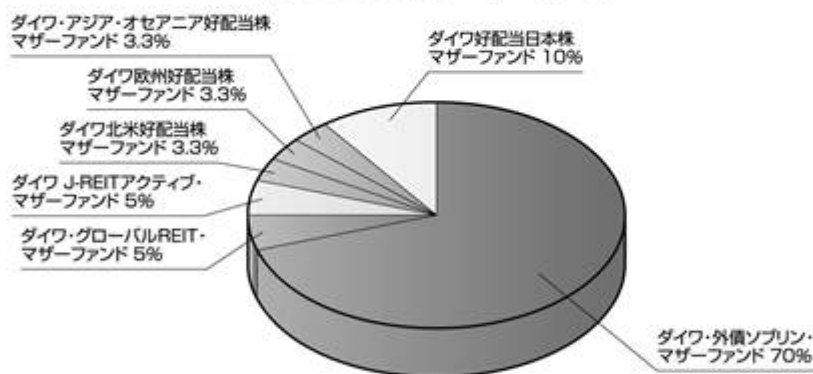
各ファンド(安定重視ポートフォリオ/インカム重視ポートフォリオ/成長重視ポートフォリオ)における各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

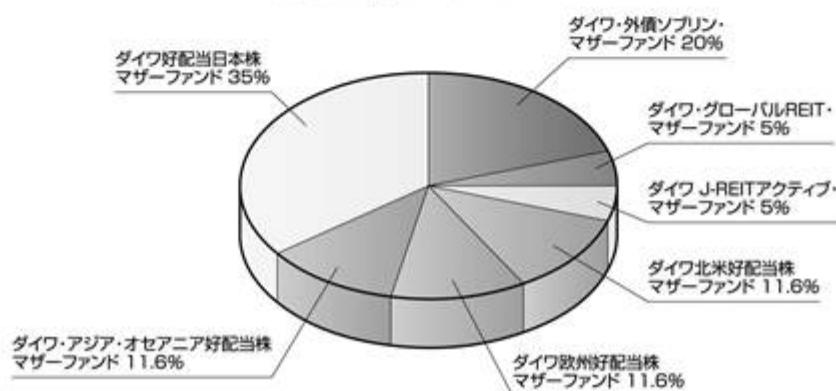
〈安定重視ポートフォリオ〉



〈インカム重視ポートフォリオ〉



〈成長重視ポートフォリオ〉



(2) 【投資対象】

〈各ファンド共通〉

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

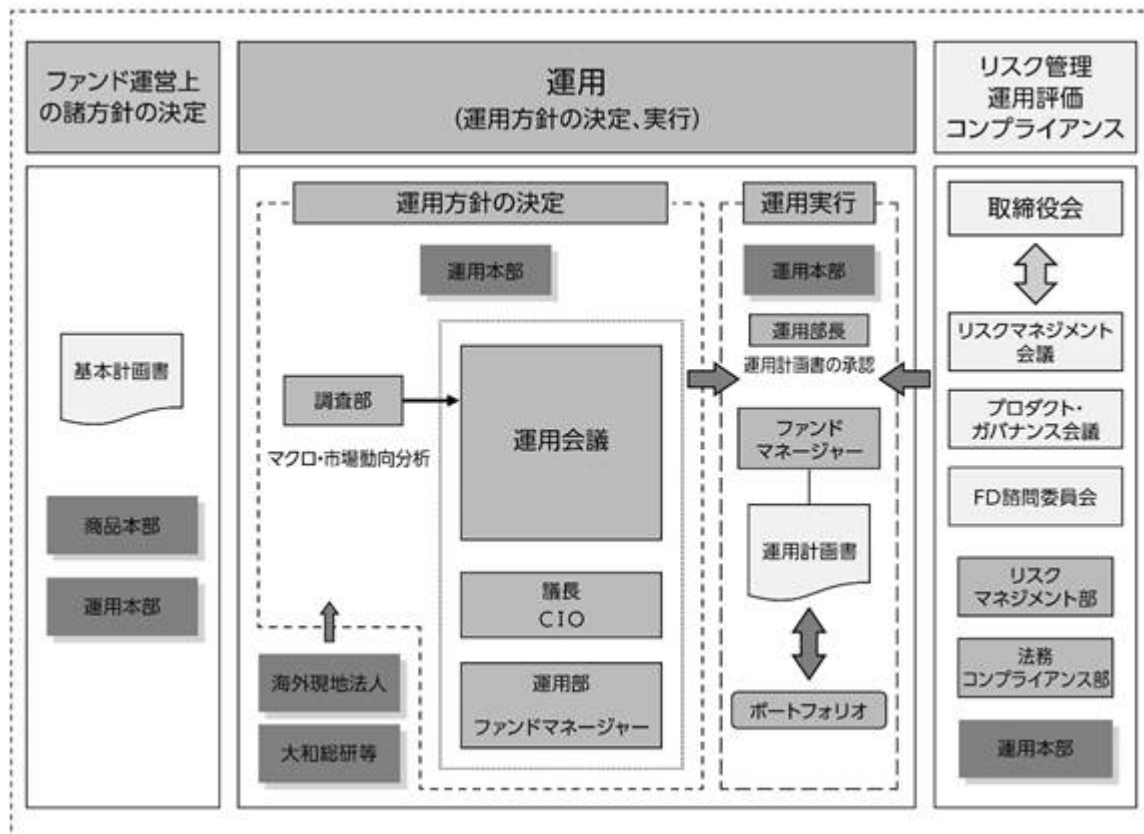
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議および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。

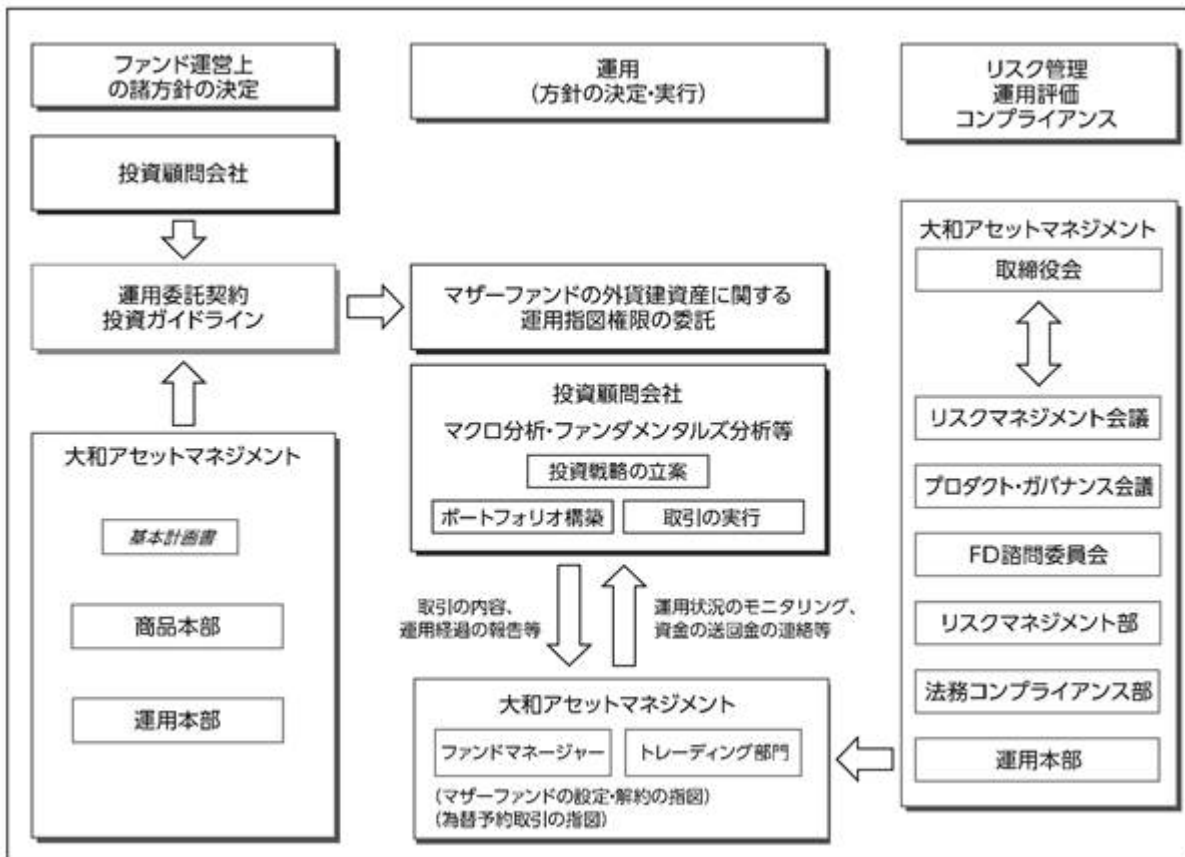
ハ．FD諮問委員会

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、取締役会に意見を述べます。

受託会社に対する管理体制

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

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



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．（前 に同じ。）

上記の運用体制は2024年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

< 安定重視ポートフォリオ / 成長重視ポートフォリオ >

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

原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含

みます。)等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

<インカム重視ポートフォリオ>

(安定重視ポートフォリオ/成長重視ポートフォリオと同規定)

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

(安定重視ポートフォリオ/成長重視ポートフォリオと同規定)

(5)【投資制限】

<各ファンド共通>

株式(信託約款)

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

外国為替予約取引(信託約款)

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

信用リスク集中回避(信託約款)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ(信託約款)

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もし

くは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

ロ．海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。

ア．米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。

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

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

イ．ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします(ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。)。

ウ．国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

た場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2. ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2.～16.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの八.と同規定）

スワップ取引

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

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

ホ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

金利先渡取引

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

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

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

4．外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

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

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

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

ヘ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

ハ．(ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定)

ニ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定)

ホ．(ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定)

(2) 投資対象

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

1. ~ 11. (ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

(3) 主な投資制限

<各ファンド共通>

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2) の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

- 1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- 2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

(4) 運用指図権限の委託

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

(ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定)

(ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定)

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

(ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定)

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。
- ロ．株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。
- ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。
- ニ．J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

2. ~10. (ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

12. ~20. (ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定)

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3

号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

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

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

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

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

ロ. リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

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

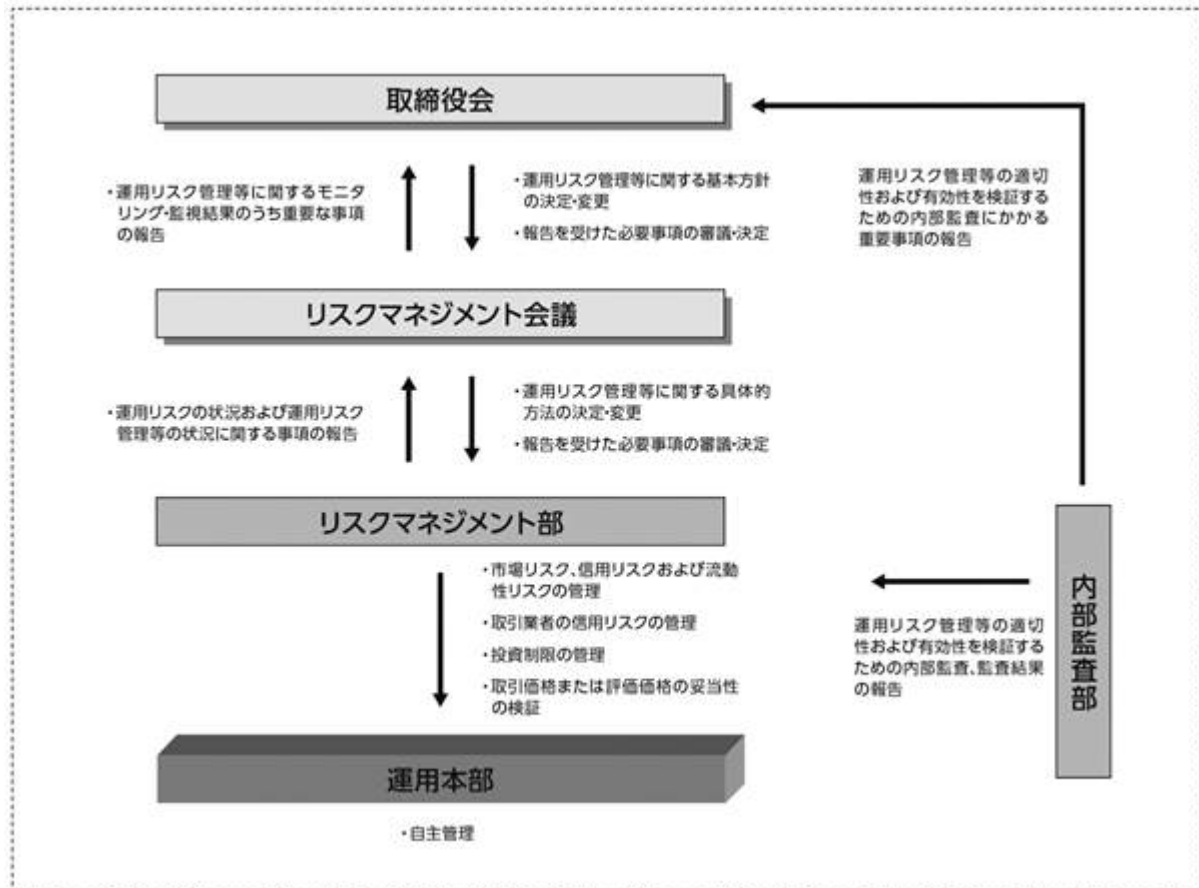
流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

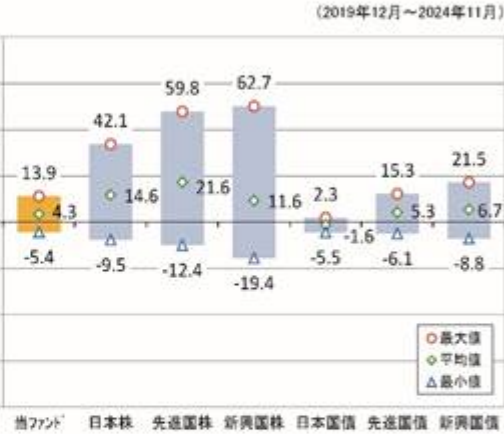
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

[安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）]



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



[インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）]



【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016. J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

イ．安定重視ポートフォリオ

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

ロ．インカム重視ポートフォリオ

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

ハ．成長重視ポートフォリオ

	委託会社	販売会社 （各販売会社の 取扱純資産総 額に応じて）	受託会社

100億円以下の部分	年率1.35%(税抜)から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.70% (税抜)	年率0.05% (税抜)
100億円超 200億円以下の部分		年率0.75% (税抜)	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.80% (税抜)	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.85% (税抜)	
1,000億円超の部分		年率0.90% (税抜)	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

イ. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

ロ. ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2024年11月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1)【投資状況】（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	880,367,273	99.15
内 日本	880,367,273	99.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,549,682	0.85
純資産総額	887,916,955	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11月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	257,256,220	1.2157 312,750,965	1.2122 311,845,989	35.12
2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	143,475,758	2.1643 310,534,542	2.1381 306,765,518	34.55
3	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	14,844,453	6.0380 89,632,089	5.9415 88,198,317	9.93
4	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,316,599	3.3626 44,778,742	3.3483 44,587,968	5.02
5	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,102,527	4.7783 43,495,502	4.7991 43,683,937	4.92
6	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,835,563	4.4018 30,089,176	4.1693 28,499,512	3.21

7	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,942,864	7.3400 28,940,621	7.2013 28,393,746	3.20
8	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,276,100	3.1377 29,105,961	3.0608 28,392,286	3.20

(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	99.15%
合計	99.15%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,466,139,398	1,473,605,263	0.9819	0.9869
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,332,286,357	1,339,328,742	0.9459	0.9509
第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,275,810,635	1,280,763,009	0.9017	0.9052
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,158,313,348	1,162,998,429	0.8653	0.8688
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,123,093,842	1,126,188,676	0.9072	0.9097

第24特定期間末 (2017年11月10日)	1,034,788,125	1,036,447,975	0.9351	0.9366
第25特定期間末 (2018年5月10日)	967,647,840	969,234,113	0.9150	0.9165
第26特定期間末 (2018年11月12日)	893,566,366	895,052,636	0.9018	0.9033
第27特定期間末 (2019年5月10日)	872,820,093	874,284,036	0.8943	0.8958
第28特定期間末 (2019年11月11日)	832,937,076	834,300,311	0.9165	0.9180
第29特定期間末 (2020年5月11日)	725,646,190	726,897,697	0.8697	0.8712
第30特定期間末 (2020年11月10日)	698,324,933	699,468,589	0.9159	0.9174
第31特定期間末 (2021年5月10日)	714,859,638	715,954,396	0.9795	0.9810
第32特定期間末 (2021年11月10日)	695,561,498	696,618,226	0.9873	0.9888
第33特定期間末 (2022年5月10日)	702,489,038	703,588,144	0.9587	0.9602
第34特定期間末 (2022年11月10日)	700,073,137	701,163,612	0.9630	0.9645
第35特定期間末 (2023年5月10日)	769,000,198	770,194,064	0.9662	0.9677
第36特定期間末 (2023年11月10日)	842,145,023	843,412,237	0.9968	0.9983
2023年11月末日	871,287,659	-	1.0127	-
12月末日	916,233,365	-	1.0218	-
2024年1月末日	922,731,062	-	1.0246	-
2月末日	936,484,826	-	1.0366	-
3月末日	944,280,392	-	1.0428	-
4月末日	931,277,280	-	1.0456	-
第37特定期間末 (2024年5月10日)	918,550,997	931,892,952	1.0327	1.0477
5月末日	925,735,022	-	1.0312	-
6月末日	950,258,461	-	1.0526	-
7月末日	887,861,405	-	1.0078	-
8月末日	882,063,437	-	1.0033	-
9月末日	877,323,624	-	1.0048	-

10月末日	889,019,808	-	1.0186	-
第38特定期間末 (2024年11月11日)	884,449,089	890,586,683	1.0087	1.0157
11月末日	887,916,955	-	0.9979	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第19特定期間	0.0150
第20特定期間	0.0150
第21特定期間	0.0135
第22特定期間	0.0105
第23特定期間	0.0075
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045
第34特定期間	0.0045
第35特定期間	0.0045
第36特定期間	0.0045
第37特定期間	0.0380
第38特定期間	0.0335

【収益率の推移】

	収益率(%)
第19特定期間	3.7
第20特定期間	2.1
第21特定期間	3.2
第22特定期間	2.9
第23特定期間	5.7
第24特定期間	3.6
第25特定期間	1.7
第26特定期間	1.0
第27特定期間	0.3

第28特定期間	3.0
第29特定期間	4.6
第30特定期間	5.8
第31特定期間	7.4
第32特定期間	1.3
第33特定期間	2.4
第34特定期間	0.9
第35特定期間	0.8
第36特定期間	3.6
第37特定期間	7.4
第38特定期間	0.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第19特定期間	30,337,306	165,374,860
第20特定期間	28,106,161	112,802,115
第21特定期間	74,111,919	67,624,842
第22特定期間	25,510,906	101,880,470
第23特定期間	16,442,452	117,103,386
第24特定期間	50,120,711	181,487,643
第25特定期間	19,575,536	68,626,578
第26特定期間	31,692,198	98,360,995
第27特定期間	48,286,397	63,170,843
第28特定期間	8,617,791	75,756,294
第29特定期間	11,410,328	85,896,293
第30特定期間	10,881,980	82,782,003
第31特定期間	61,263,599	93,862,473
第32特定期間	30,258,792	55,612,312
第33特定期間	49,921,905	21,669,644
第34特定期間	39,944,612	45,699,082
第35特定期間	107,674,511	38,747,198
第36特定期間	117,401,286	68,502,505
第37特定期間	105,110,672	60,456,458
第38特定期間	58,529,876	71,194,327

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		12,891,142,639	82.95
	内 ユーロ	3,379,061,522	21.74
	内 ノルウェー	230,353,715	1.48
	内 スウェーデン	112,188,997	0.72
	内 デンマーク	583,854,996	3.76
	内 イギリス	1,875,824,027	12.07
	内 ポーランド	528,001,039	3.40
	内 チェコ	284,495,488	1.83
	内 カナダ	828,794,705	5.33
	内 アメリカ	3,853,849,608	24.80
内 オーストラリア	1,214,718,542	7.82	
特殊債券		1,909,513,054	12.29
	内 ユーロ	567,290,892	3.65
	内 カナダ	584,703,749	3.76
	内 オーストラリア	757,518,413	4.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		740,876,708	4.77
純資産総額		15,541,532,401	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11月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	16,600,400	83.62 2,092,485,323	82.91 2,074,918,865	0.875000 2030/11/15	13.35
2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	96.47 1,403,196,339	97.13 1,412,810,262	1.400000 2028/04/30	9.09
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	7,400,000	90.13 1,061,815,284	93.59 1,102,647,537	2.900000 2046/10/31	7.09
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	9,000,000	102.82 907,260,199	101.54 895,957,167	4.500000 2033/04/21	5.76
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	63.35 734,023,199	62.55 724,742,912	1.125000 2040/08/15	4.66

6	UNITED KINGDOM GILT	イギリス	国債証券	3,650,000	98.10 685,721,572	99.76 697,261,047	4.250000 2034/07/31	4.49
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,900,000	94.37 697,091,736	93.96 694,042,534	3.375000 2033/05/15	4.47
8	EUROPEAN INVESTMENT BANK	ユーロ	特殊債券	3,500,000	100.94 562,443,252	101.81 567,290,892	2.750000 2030/07/30	3.65
9	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	78.02 462,546,544	78.01 462,481,336	0.250000 2031/07/31	2.98
10	INTL. FIN. CORP.	オーストラ リア	特殊債券	5,600,000	82.25 451,594,200	81.98 450,106,345	1.250000 2031/02/06	2.90
11	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	99.51 428,964,388	99.86 430,481,747	1.750000 2025/11/15	2.77
12	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	3,754,000	85.50 345,216,158	85.71 346,051,905	0.500000 2030/12/01	2.23
13	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,000,000	92.95 343,663,888	93.07 344,081,651	2.750000 2028/04/25	2.21
14	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	106.14 329,516,538	108.97 338,311,303	3.750000 2045/06/22	2.18
15	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	3,000,000	100.09 322,962,970	100.50 324,289,062	3.550000 2032/09/15	2.09
16	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラ リア	国債証券	6,000,000	55.20 324,732,009	54.18 318,761,373	1.750000 2051/06/21	2.05
17	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,600,000	72.78 301,288,228	75.15 311,060,880	1.200000 2040/10/31	2.00
18	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,400,000	100.65 259,815,848	100.88 260,414,686	3.650000 2033/06/15	1.68
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	2,600,000	65.72 257,588,129	64.71 253,614,020	2.250000 2052/02/15	1.63
20	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	17,000,000	98.89 229,485,847	99.26 230,353,714	1.750000 2025/03/13	1.48
21	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラ リア	特殊債券	2,500,000	93.51 229,193,010	93.69 229,634,190	1.100000 2026/12/16	1.48
22	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	2,200,000	89.88 212,683,996	91.50 216,507,614	2.750000 2048/12/01	1.39
23	Czech Republic Government Bond	チェコ	国債証券	30,000,000	95.79 181,022,827	96.15 181,691,770	1.000000 2026/06/26	1.17
24	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	94.02 180,044,642	93.12 178,315,488	4.250000 2046/12/07	1.15
25	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	91.73 175,663,351	91.58 175,374,201	1.625000 2028/10/22	1.13

26	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	102.24 164,938,680	103.63 167,185,937	3.500000 2045/12/01	1.08
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,800,000	48.03 165,550,764	47.64 164,206,504	1.250000 2051/07/31	1.06
28	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,500,000	79.83 162,331,342	79.81 162,284,574	1.250000 2030/10/25	1.04
29	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	5,500,000	126.31 148,259,436	130.67 153,373,247	4.500000 2039/11/15	0.99
30	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	8,230,000	98.18 111,588,891	98.70 112,188,997	1.000000 2026/11/12	0.72

(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	82.95%
特殊債券	12.29%
合計	95.23%

(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。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	74,415,395,220	98.82
内 日本	74,415,395,220	98.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	886,471,680	1.18
純資産総額	75,301,866,900	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11月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	101 20年国債	日本	国債証券	4,760,000,000	108.07 5,144,515,000	105.80 5,036,080,000	2.400000 2028/03/20	6.69
2	30 30年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	114.16 5,137,470,000	110.78 4,985,370,000	2.300000 2039/03/20	6.62
3	26 30年国債	日本	国債証券	4,400,000,000	115.67 5,089,620,000	112.73 4,960,428,000	2.400000 2037/03/20	6.59
4	94 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	105.69 3,804,876,000	103.45 3,724,380,000	2.100000 2027/03/20	4.95
5	110 20年国債	日本	国債証券	3,300,000,000	108.54 3,581,985,000	105.99 3,497,769,000	2.100000 2029/03/20	4.64
6	86 20年国債	日本	国債証券	3,400,000,000	104.26 3,544,840,000	102.29 3,477,894,000	2.300000 2026/03/20	4.62
7	75 20年国債	日本	国債証券	3,374,000,000	102.09 3,444,820,260	100.55 3,392,826,920	2.100000 2025/03/20	4.51
8	20 30年国債	日本	国債証券	2,900,000,000	117.44 3,405,760,000	113.78 3,299,881,000	2.500000 2035/09/20	4.38
9	116 20年国債	日本	国債証券	2,800,000,000	110.70 3,099,793,000	107.71 3,015,992,000	2.200000 2030/03/20	4.01
10	16 30年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	116.84 2,921,000,000	113.53 2,838,475,000	2.500000 2034/09/20	3.77
11	125 20年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	111.88 2,909,131,000	109.04 2,835,170,000	2.200000 2031/03/20	3.77
12	24 30年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	117.81 2,827,440,000	113.84 2,732,376,000	2.500000 2036/09/20	3.63
13	28 30年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	117.86 2,828,784,000	113.73 2,729,568,000	2.500000 2038/03/20	3.62
14	134 20年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	109.56 2,629,464,000	107.11 2,570,760,000	1.800000 2032/03/20	3.41
15	143 20年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	108.14 2,487,375,000	105.77 2,432,733,000	1.600000 2033/03/20	3.23

16	12 30年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	112.60 2,477,200,000	109.91 2,418,218,000	2.100000 2033/09/20	3.21
17	140 20年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	108.92 2,396,240,000	106.52 2,343,638,000	1.700000 2032/09/20	3.11
18	22 30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	117.12 2,342,435,000	113.89 2,277,880,000	2.500000 2036/03/20	3.02
19	29 30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	116.50 2,330,000,000	112.34 2,246,900,000	2.400000 2038/09/20	2.98
20	14 30年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	115.78 2,199,863,000	112.57 2,138,963,000	2.400000 2034/03/20	2.84
21	130 20年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	109.31 2,186,200,000	106.89 2,137,940,000	1.800000 2031/09/20	2.84
22	121 20年国債	日本	国債証券	1,800,000,000	109.43 1,969,805,000	106.65 1,919,844,000	1.900000 2030/09/20	2.55
23	18 30年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	112.67 1,690,060,000	111.77 1,676,550,000	2.300000 2035/03/20	2.23
24	88 20年国債	日本	国債証券	1,460,000,000	104.77 1,529,642,000	102.67 1,499,098,800	2.300000 2026/06/20	1.99
25	80 20年国債	日本	国債証券	1,473,000,000	102.56 1,510,740,800	100.97 1,487,288,100	2.100000 2025/06/20	1.98
26	1 30年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	113.15 1,527,606,000	109.80 1,482,340,500	2.800000 2029/09/20	1.97
27	95 20年国債	日本	国債証券	1,205,000,000	106.72 1,285,994,000	104.31 1,257,031,900	2.300000 2027/06/20	1.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	98.82%
合計	98.82%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	99,338,612,806	97.32
内 香港	1,358,151,011	1.33
内 シンガポール	6,682,063,424	6.55
内 イギリス	10,162,497,668	9.96
内 ベルギー	1,703,378,896	1.67
内 フランス	5,966,160,011	5.84
内 スペイン	616,586,230	0.60
内 カナダ	1,240,358,788	1.22
内 アメリカ	52,916,747,504	51.84
内 オーストラリア	17,882,842,040	17.52
内 ニューゼaland	809,827,234	0.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,737,280,578	2.68
純資産総額	102,075,893,384	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)	22,736,180	0.02
内 日本	22,736,180	0.02
為替予約取引(売建)	22,742,772	0.02
内 日本	22,742,772	0.02

(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11月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

1	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,153,784	3,495.02 7,527,618,620	3,748.06 8,072,531,474	7.91
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	233,943	19,472.59 4,555,476,871	20,998.08 4,912,354,297	4.81
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	165,361	24,249.54 4,009,928,812	29,436.50 4,867,650,267	4.77
4	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	216,849	19,487.66 4,225,881,145	17,757.17 3,850,624,991	3.77
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	115,045	24,857.02 2,859,676,556	27,698.47 3,186,571,056	3.12
6	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	17,959	132,134.16 2,372,997,412	147,589.53 2,650,560,441	2.60
7	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	482,875	5,525.82 2,668,288,774	5,217.11 2,519,212,667	2.47
8	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,659,006	516.67 2,407,172,357	514.71 2,398,036,978	2.35
9	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	467,981	5,131.18 2,401,299,240	4,914.12 2,299,716,664	2.25
10	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	43,378	54,717.11 2,373,518,910	52,964.00 2,297,472,670	2.25
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	80,286	26,616.61 2,136,947,301	26,029.78 2,089,827,174	2.05
12	KLEPIERRE	フランス	投資証券	450,661	4,653.41 2,097,139,226	4,534.01 2,043,304,185	2.00
13	UDR INC	アメリカ	投資証券	288,183	7,080.25 2,040,409,934	6,983.78 2,012,607,882	1.97
14	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	102,731	17,815.96 1,830,251,448	18,727.93 1,923,939,758	1.88
15	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	98,512	21,391.36 2,107,310,043	19,379.13 1,909,077,288	1.87
16	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,422,477	460.15 2,035,138,975	425.88 1,883,454,676	1.85
17	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,209,999	1,551.28 1,877,110,883	1,553.93 1,880,258,586	1.84
18	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	8,320,000	243.50 2,026,871,197	222.49 1,851,138,432	1.81
19	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	640,201	2,672.16 1,710,756,032	2,778.13 1,778,566,854	1.74
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,186,461	1,731.83 2,054,755,353	1,494.38 1,773,033,033	1.74

21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	439,201	3,626.80 1,592,896,119	3,886.07 1,706,768,992	1.67
22	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	イギリス	投資証券	4,319,722	396.00 1,710,826,610	370.53 1,600,600,200	1.57
23	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	7,349,987	220.00 1,617,059,258	215.68 1,585,303,996	1.55
24	CROWN CASTLE INTL CORP	アメリカ	投資証券	93,049	18,126.48 1,686,651,303	16,083.95 1,496,596,208	1.47
25	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	118,946	12,338.00 1,467,555,748	12,363.47 1,470,585,541	1.44
26	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,263,770	1,273.59 1,609,663,596	1,160.42 1,466,515,863	1.44
27	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	2,909,005	509.80 1,483,034,021	500.00 1,454,514,136	1.42
28	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	アメリカ	投資証券	510,886	2,809.79 1,435,484,213	2,785.67 1,423,162,460	1.39
29	DIGITAL CORE REIT UNITS	シンガポール	投資証券	14,484,556	88.33 1,280,594,777	94.96 1,375,543,242	1.35
30	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	5,539,768	238.23 1,319,778,817	248.04 1,374,090,702	1.35

(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	97.32%
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
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年12月	買建	150,892	22,891,149	22,736,180	0.02%
		シンガポール・ドル売/円買 2024年12月	売建	202,451	22,891,149	22,742,772	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	165,361,589,706	97.30
内 日本	165,361,589,706	97.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,595,638,806	2.70
純資産総額	169,957,228,512	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,327,500,000	1.37
内 日本	2,327,500,000	1.37

(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11月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	87,300	129,855.59 11,336,393,024	125,500.00 10,956,150,000	6.45
2	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	115,565	92,239.59 10,659,669,191	91,300.00 10,551,084,500	6.21

3	日本プロロジスリート	日本	投資証券	40,434	245,700.00 9,934,633,800	236,100.00 9,546,467,400	5.62
4	GLP投資法人	日本	投資証券	64,766	129,179.98 8,366,471,196	127,300.00 8,244,711,800	4.85
5	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	34,901	232,100.00 8,100,522,100	233,000.00 8,131,933,000	4.78
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	56,451	141,170.98 7,969,243,082	141,700.00 7,999,106,700	4.71
7	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	51,905	146,708.69 7,614,914,961	147,300.00 7,645,606,500	4.50
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	103,956	63,312.87 6,581,753,641	63,600.00 6,611,601,600	3.89
9	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	11,841	563,917.71 6,677,349,636	554,000.00 6,559,914,000	3.86
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	38,853	160,300.00 6,228,135,900	166,700.00 6,476,795,100	3.81
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	89,133	68,478.95 6,103,735,029	68,200.00 6,078,870,600	3.58
12	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	8,552	590,706.90 5,051,725,446	581,000.00 4,968,712,000	2.92
13	産業ファンド	日本	投資証券	41,218	114,504.87 4,719,662,063	114,600.00 4,723,582,800	2.78
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	13,233	336,837.98 4,457,377,033	330,500.00 4,373,506,500	2.57
15	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	31,421	138,900.00 4,364,376,900	136,500.00 4,288,966,500	2.52
16	API投資法人	日本	投資証券	13,101	324,500.00 4,251,274,500	321,000.00 4,205,421,000	2.47
17	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	12,184	290,478.94 3,539,195,497	288,300.00 3,512,647,200	2.07
18	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	11,869	303,293.37 3,599,789,048	295,000.00 3,501,355,000	2.06
19	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,601	131,808.37 3,110,809,426	132,800.00 3,134,212,800	1.84
20	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	20,689	144,200.00 2,983,353,800	143,900.00 2,977,147,100	1.75
21	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	7,821	354,028.51 2,768,857,013	348,000.00 2,721,708,000	1.60
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	6,824	404,736.69 2,761,923,213	395,000.00 2,695,480,000	1.59

23	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,199	317,000.00 2,599,083,000	316,000.00 2,590,884,000	1.52
24	森ヒルズリート	日本	投資証券	19,917	127,443.17 2,538,285,642	124,900.00 2,487,633,300	1.46
25	CREロジスティクスファンド	日本	投資証券	16,616	139,003.01 2,309,674,056	142,400.00 2,366,118,400	1.39
26	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	8,943	274,243.18 2,452,556,802	263,800.00 2,359,163,400	1.39
27	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	19,967	109,100.00 2,178,399,700	113,600.00 2,268,251,200	1.33
28	三井不ロジパーク	日本	投資証券	22,393.67	99,422.07 2,226,425,335	101,200.00 2,266,239,606	1.33
29	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	24,511	91,511.26 2,243,032,554	90,900.00 2,228,049,900	1.31
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	6,870	306,014.88 2,102,322,257	300,000.00 2,061,000,000	1.21

(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	97.30%
合計	97.30%

(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 0612月	買建	1,400	2,340,800,000	2,327,500,000	1.37%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	5,405,535,093	72.41
内 カナダ	77,662,276	1.04
内 アメリカ	5,327,872,817	71.37
ハイブリッド優先証券	1,203,935,338	16.13
内 アメリカ	1,203,935,338	16.13
投資証券	65,133,355	0.87
内 アメリカ	65,133,355	0.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	790,298,993	10.59
純資産総額	7,464,902,779	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)	407,061,149	5.45
内 日本	407,061,149	5.45
為替予約取引(売建)	228,201	0.00
内 日本	228,201	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) 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11月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	10,434	34,868.42 363,817,291	35,413.34 369,502,875	4.95

2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,491	63,190.81 346,981,106	63,761.51 350,114,466	4.69
3	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	16,734	20,821.26 348,423,116	20,401.15 341,392,871	4.57
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	7,695	28,269.77 217,535,954	31,013.24 238,646,940	3.20
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	7,057	24,866.07 175,479,859	25,509.73 180,022,166	2.41
6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	2,037	88,999.91 181,292,818	85,801.20 174,777,061	2.34
7	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	4,926	27,469.95 135,317,619	24,068.65 118,562,198	1.59
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	2,957	33,385.89 98,722,092	37,653.34 111,340,940	1.49
9	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,872	46,705.28 87,432,287	44,480.35 83,267,232	1.12
10	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,608	33,036.17 53,122,175	50,179.83 80,689,180	1.08
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	661	131,301.92 86,790,640	118,811.76 78,534,574	1.05
12	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	848	78,799.33 66,821,836	91,262.51 77,390,615	1.04
13	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	10,625	6,317.51 67,123,580	7,200.84 76,509,029	1.02
14	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	1,356	52,097.25 70,643,873	56,072.26 76,033,992	1.02
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	1,552	42,309.70 65,664,659	47,437.87 73,623,587	0.99
16	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	465	142,400.61 66,216,304	156,980.63 72,995,996	0.98
17	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	4,104	18,501.37 75,929,729	17,736.06 72,788,825	0.98

18	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	492	134,122.42 65,988,232	144,944.04 71,312,471	0.96
19	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	20,069	3,204.73 64,315,775	3,507.71 70,396,429	0.94
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,091	62,620.41 68,318,868	64,394.62 70,254,531	0.94
21	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	2,049	35,435.35 72,607,162	34,205.92 70,087,932	0.94
22	MOTOROLA SOLUTIONS INC	アメリカ	株式	情報技術	899	71,286.45 64,086,546	75,469.48 67,847,070	0.91
23	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	1,943	32,182.99 62,531,550	34,438.06 66,913,151	0.90
24	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	アメリカ	株式	金融	5,322	11,533.11 61,379,251	12,321.48 65,574,957	0.88
25	CSX CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービス	11,875	5,337.85 63,387,729	5,514.06 65,479,572	0.88
26	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	1,474	43,520.14 64,148,694	43,765.85 64,510,865	0.86
27	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	2,646	24,778.64 65,564,285	24,297.78 64,291,927	0.86
28	HUNTINGTON BANCSHARES INC	アメリカ	株式	金融	22,734	2,339.48 53,185,847	2,713.32 61,684,617	0.83
29	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	761	76,373.92 58,120,560	80,250.96 61,070,981	0.82
30	CUMMINS INC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	1,061	51,005.89 54,117,253	55,929.06 59,340,735	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	72.41%
ハイブリッド優先証券	16.13%
投資証券	0.87%
合計	89.41%

(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

業種	投資比率
エネルギー	3.04%
素材	1.47%
資本財・サービス	6.76%
一般消費財・サービス	7.77%
生活必需品	4.40%
ヘルスケア	7.53%
金融	10.65%
情報技術	22.22%
コミュニケーション・サービス	6.78%
公益事業	1.79%
合計	72.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年12月	買建	2,701,512	406,196,283	407,061,149	5.45%
		カナダ・ドル売/円買 2024年12月	売建	2,122	229,818	228,201	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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年11月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,682,380,192	86.92
内 デンマーク	59,252,354	3.06
内 イギリス	372,914,055	19.27

内 アイルランド	15,023,513	0.78
内 オランダ	81,807,013	4.23
内 フランス	423,537,864	21.88
内 ドイツ	329,358,304	17.02
内 スイス	259,971,143	13.43
内 スペイン	17,709,995	0.92
内 イタリア	122,805,951	6.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	253,097,027	13.08
純資産総額	1,935,477,219	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)	159,154,500	8.22
内 日本	159,154,500	8.22

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

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

(注3) 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11月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・ サービス	2,229	38,789.08 86,460,859	38,104.52 84,934,975	4.39
2	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニ ケーション・ サービス	17,592	4,374.81 76,961,763	4,796.69 84,383,476	4.36
3	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・ サービス	2,811	29,493.39 82,905,925	28,796.09 80,945,826	4.18
4	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需 品	5,601	14,417.03 80,749,805	13,103.90 73,394,984	3.79
5	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,406	17,149.29 75,559,789	15,966.11 70,346,691	3.63
6	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	680	89,217.36 60,667,808	95,064.88 64,644,118	3.34
7	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	3,714	17,503.06 65,006,395	15,953.78 59,252,354	3.06

8	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	11,804	4,958.63 58,531,710	4,847.56 57,220,709	2.96
9	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	40,796	1,294.08 52,793,670	1,401.51 57,176,218	2.95
10	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	682	80,396.00 54,830,072	78,151.28 53,299,173	2.75
11	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,151	47,648.56 54,843,493	46,056.56 53,011,101	2.74
12	ASTRAZENECA PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	2,565	22,856.24 58,626,272	20,286.45 52,034,746	2.69
13	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	78	770,093.92 60,067,326	661,350.64 51,585,350	2.67
14	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	5,507	9,233.64 50,849,698	9,057.47 49,879,526	2.58
15	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	45,016	1,142.41 51,427,142	1,077.78 48,517,525	2.51
16	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	81,683	593.49 48,478,664	585.53 47,828,467	2.47
17	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	81,160	624.38 50,681,336	573.51 46,546,721	2.40
18	AXA SA	フランス	株式	金融	8,612	5,634.08 48,520,766	5,174.00 44,558,488	2.30
19	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	5,130	9,948.40 51,035,333	8,631.82 44,281,257	2.29
20	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	22,742	1,931.17 43,918,819	1,904.55 43,313,493	2.24
21	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財・サービス	8,652	5,452.60 47,175,895	4,908.13 42,465,193	2.19
22	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,757	29,253.00 51,397,521	24,142.68 42,418,689	2.19
23	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	2,517	16,171.53 40,703,756	14,662.32 36,905,059	1.91
24	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	4,005	10,016.86 40,117,540	8,937.48 35,794,639	1.85
25	DANONE	フランス	株式	生活必需品	3,407	10,363.92 35,309,875	10,300.24 35,092,918	1.81
26	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	オランダ	株式	生活必需品	6,531	4,787.14 31,264,837	5,202.65 33,978,546	1.76

27	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	3,008	12,137.40 36,509,323	10,972.06 33,003,969	1.71
28	GSK	イギリス	株式	ヘルスケア	12,765	2,861.81 36,531,106	2,566.92 32,766,777	1.69
29	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	フランス	株式	資本財・サービス	2,286	13,229.52 30,242,683	13,700.75 31,319,919	1.62
30	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	31,017	919.15 28,509,338	918.19 28,479,639	1.47

(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	86.92%
合計	86.92%

(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	6.68%
素材	3.94%
資本財・サービス	10.96%
一般消費財・サービス	3.90%
生活必需品	9.94%
ヘルスケア	12.98%
金融	22.50%
情報技術	2.19%
コミュニケーション・サービス	8.16%
公益事業	5.66%
合計	86.92%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2024年12月	買建	1,000,000	158,884,200	159,154,500	8.22%
--------	----	------------------	----	-----------	-------------	-------------	-------

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年11月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		699,347,150	94.82
	内 韓国	113,386,406	15.37
	内 台湾	225,609,057	30.59
	内 香港	69,738,297	9.46
	内 シンガポール	68,841,683	9.33
	内 オーストラリア	221,771,707	30.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		38,232,145	5.18
純資産総額		737,579,295	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)		29,532,320	4.00
	内 日本	29,532,320	4.00
為替予約取引(売建)		9,265,426	1.26
	内 日本	9,265,426	1.26

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産 (2024年11月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

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

1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	14,300	4,839.18 69,200,360	4,653.95 66,551,542	9.02
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	7,205	6,578.56 47,398,525	6,005.10 43,266,746	5.87
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラ リア	株式	金融	2,630	13,413.83 35,278,380	15,547.18 40,889,092	5.54
4	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	29,000	921.52 26,724,347	905.32 26,254,321	3.56
5	BHP GROUP LTD	オーストラ リア	株式	素材	6,200	4,294.15 26,623,742	3,928.46 24,356,469	3.30
6	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	4,000	5,973.73 23,894,928	5,811.65 23,246,616	3.15
7	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	19,000	1,279.38 24,308,382	1,122.49 21,327,339	2.89
8	WESTPAC BANKING CORP	オーストラ リア	株式	金融	6,500	3,044.14 19,786,923	3,274.53 21,284,484	2.89
9	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポー ル	株式	金融	4,400	4,397.03 19,346,968	4,747.63 20,889,583	2.83
10	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	オーストラ リア	株式	金融	6,720	3,025.51 20,331,457	3,088.26 20,753,107	2.81
11	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラ リア	株式	金融	5,300	3,689.24 19,553,000	3,875.52 20,540,262	2.78
12	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	1,130	20,287.50 22,924,875	17,431.02 19,697,053	2.67
13	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	シンガポー ル	株式	金融	10,200	1,708.02 17,421,845	1,829.38 18,659,713	2.53
14	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	10,000	1,794.43 17,944,350	1,778.22 17,782,272	2.41
15	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポー ル	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	51,600	353.96 18,264,620	342.72 17,684,791	2.40
16	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラ リア	株式	金融	760	22,930.57 17,427,237	22,804.10 17,331,119	2.35
17	CSL LTD	オーストラ リア	株式	ヘルスケア	595	29,344.35 17,459,890	27,959.04 16,635,633	2.26
18	WESFARMERS LTD	オーストラ リア	株式	一般消費 財・サービ ス	2,230	6,877.50 15,336,838	7,025.54 15,666,968	2.12

19	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	台湾	株式	金融	36,600	419.08 15,338,599	411.67 15,067,419	2.04
20	KT&G CORP	韓国	株式	生活必需品	1,120	11,609.86 13,003,043	13,135.48 14,711,738	1.99
21	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費財・サービス	605	26,887.70 16,267,059	23,695.80 14,335,959	1.94
22	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	1,250	10,517.04 13,146,300	10,603.60 13,254,500	1.80
23	QBE INSURANCE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	6,400	1,648.05 10,547,535	1,960.80 12,549,120	1.70
24	ASIA CEMENT CORP	台湾	株式	素材	63,000	213.01 13,420,058	195.88 12,340,619	1.67
25	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	18,000	731.66 13,169,995	680.72 12,253,097	1.66
26	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	9,000	1,340.44 12,063,993	1,333.67 12,003,034	1.63
27	CAPITALAND INVESTMENT LTD	シンガポール	株式	不動産	37,700	339.35 12,793,774	307.89 11,607,596	1.57
28	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	香港	株式	金融	24,500	495.87 12,148,864	471.65 11,555,658	1.57
29	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	香港	株式	不動産	23,000	494.90 11,382,781	478.43 11,004,097	1.49
30	ASUSTEK COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	4,000	2,699.75 10,799,026	2,690.49 10,761,979	1.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.82%
合計	94.82%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.45%
素材	6.85%
資本財・サービス	1.28%
一般消費財・サービス	5.17%

生活必需品	1.99%
ヘルスケア	2.26%
金融	32.49%
情報技術	35.41%
コミュニケーション・サービス	2.40%
公益事業	1.84%
不動産	3.68%
合計	94.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年12月	買建	134,529	20,200,000	20,270,720	2.75%
		台湾ドル買/円売 2024年12月	買建	2,000,000	9,269,177	9,261,600	1.26%
		米ドル売/円買 2024年12月	売建	61,491	9,269,177	9,265,426	1.26%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年11月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	42,805,091,550	95.37
内 日本	42,805,091,550	95.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,077,907,982	4.63
純資産総額	44,882,999,532	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11月29日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	573,600	3,217.00 1,845,271,200	3,686.00 2,114,289,600	4.71
2	東京海上HD	日本	株式	保険業	371,900	5,715.00 2,125,408,500	5,564.00 2,069,251,600	4.61
3	住友電工	日本	株式	非鉄金属	680,000	2,372.00 1,612,960,000	2,886.00 1,962,480,000	4.37
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	961,300	1,586.50 1,525,102,450	1,792.00 1,722,649,600	3.84
5	小松製作所	日本	株式	機械	405,900	4,083.00 1,657,289,700	4,026.00 1,634,153,400	3.64
6	三菱商事	日本	株式	卸売業	505,300	2,926.00 1,478,507,800	2,525.50 1,276,135,150	2.84
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	241,400	4,798.00 1,158,237,200	4,950.00 1,194,930,000	2.66
8	日立	日本	株式	電気機器	297,300	4,053.00 1,204,956,900	3,751.00 1,115,172,300	2.48
9	大林組	日本	株式	建設業	514,700	1,825.21 939,436,482	2,135.00 1,098,884,500	2.45
10	本田技研	日本	株式	輸送用機器	848,000	1,548.65 1,313,263,261	1,291.50 1,095,192,000	2.44
11	SANKYO	日本	株式	機械	490,200	2,150.50 1,054,175,100	2,122.50 1,040,449,500	2.32
12	三井住友トラストグループ	日本	株式	銀行業	263,900	3,430.32 905,263,001	3,746.00 988,569,400	2.20
13	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	365,200	2,555.00 933,086,000	2,551.50 931,807,800	2.08
14	MS & AD	日本	株式	保険業	274,000	3,493.00 957,082,000	3,341.00 915,434,000	2.04
15	コスモエネルギーHLDGS	日本	株式	石油・石炭製品	136,800	8,017.00 1,096,725,600	6,510.00 890,568,000	1.98
16	大東建託	日本	株式	不動産業	51,200	17,140.00 877,568,000	16,725.00 856,320,000	1.91

17	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	279,500	2,783.00 777,848,500	3,060.00 855,270,000	1.91
18	武田薬品	日本	株式	医薬品	186,800	4,234.00 790,911,200	4,083.00 762,704,400	1.70
19	セイノーホールディングス	日本	株式	陸運業	292,100	2,451.00 715,937,100	2,461.50 719,004,150	1.60
20	アイシン	日本	株式	輸送用機器	451,700	1,577.20 712,423,951	1,578.00 712,782,600	1.59
21	丸井グループ	日本	株式	小売業	219,700	2,413.00 530,136,100	2,418.00 531,234,600	1.18
22	ダイヘン	日本	株式	電気機器	73,700	6,957.28 512,752,230	7,030.00 518,111,000	1.15
23	キヤノン	日本	株式	電気機器	104,600	5,101.65 533,633,077	4,868.00 509,192,800	1.13
24	積水ハウス	日本	株式	建設業	141,000	3,853.00 543,273,000	3,540.00 499,140,000	1.11
25	九州電力	日本	株式	電気・ガス業	336,000	1,615.50 542,808,000	1,476.00 495,936,000	1.10
26	TOYO TIRE	日本	株式	ゴム製品	207,500	2,143.00 444,672,500	2,328.00 483,060,000	1.08
27	BIPROGY	日本	株式	情報・通信業	100,600	4,917.00 494,650,200	4,660.00 468,796,000	1.04
28	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	110,300	4,283.00 472,414,900	4,219.00 465,355,700	1.04
29	三菱倉庫	日本	株式	倉庫・運輸関連業	422,300	1,047.98 442,562,695	1,098.00 463,685,400	1.03
30	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	2,975,500	147.10 437,696,050	153.40 456,441,700	1.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.37%
合計	95.37%

(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	0.50%

鉱業	0.19%
建設業	5.47%
食料品	2.05%
繊維製品	0.88%
化学	5.49%
医薬品	2.47%
石油・石炭製品	1.98%
ゴム製品	2.02%
鉄鋼	0.39%
非鉄金属	6.14%
金属製品	1.28%
機械	9.48%
電気機器	6.17%
輸送用機器	7.49%
電気・ガス業	1.80%
陸運業	2.82%
倉庫・運輸関連業	1.03%
情報・通信業	5.72%
卸売業	6.30%
小売業	1.76%
銀行業	11.80%
証券、商品先物取引業	0.29%
保険業	6.65%
その他金融業	1.00%
不動産業	3.09%
サービス業	1.08%
合計	95.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 運用実績

●安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

2024年11月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,979円
純資産総額	8.8億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.4%
3カ月間	0.3%
6カ月間	-0.1%
1年間	5.6%
3年間	11.8%
5年間	20.4%
設定来	79.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 715円 設定来分配金合計額: 5,305円

決算期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	23年1月	23年3月	23年5月	23年7月	23年9月	23年11月	24年1月	24年3月	24年5月	24年7月	24年9月	24年11月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	80円	150円	150円	250円	15円	70円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	27	34.7%	日本円	51.3%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.5%	
外国債券	43	32.9%	米ドル	14.8%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.5%	
国内株式	88	9.5%	ユーロ	11.5%	修正デュレーション	住友電工	日本	0.4%	
外国株式	162	8.1%	豪ドル	6.4%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%	
国内リート・先物	51	5.0%	英ポンド	5.4%	債券格付別構成	小松製作所	日本	0.4%	
外国リート	70	4.8%	カナダ・ドル	3.3%	AAA	87.3%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.4%
外国優先出資証券	63	0.5%	デンマーク・クローネ	1.5%	AA	11.0%	日本ビルファンド	日本	0.3%
			ポーランド・ズロチ	1.3%	A	1.7%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.3%
			台湾ドル	1.0%	BBB	-	日本プロロジスリート	日本	0.3%
コール・ローン、その他		4.6%	その他	3.5%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.2%
合計	504	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.7%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

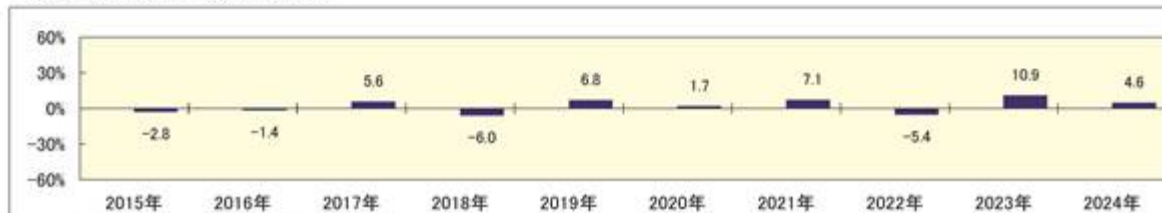
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2024年は11月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)】

(1) 【投資状況】(2024年11月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	580,799,518	99.07
内 日本	580,799,518	99.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,432,888	0.93
純資産総額	586,232,406	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11月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	191,198,451	2.1644 413,832,412	2.1381 408,801,408	69.73
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,805,181	6.0387 59,210,547	5.9415 58,257,482	9.94
3	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,662,657	3.3643 29,143,776	3.3483 29,005,174	4.95
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,029,236	4.7779 28,807,086	4.7991 28,934,906	4.94
5	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,641,023	7.3400 19,385,108	7.2013 19,018,798	3.24
6	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,049,278	3.1388 18,987,473	3.0608 18,515,630	3.16
7	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,381,100	4.4068 19,306,631	4.1693 18,266,120	3.12

(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	99.07%

合計	99.07%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,566,235,861	1,572,032,654	0.9457	0.9492
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,377,538,151	1,381,348,553	0.9038	0.9063
第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,182,765,323	1,186,295,037	0.8377	0.8402
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,075,473,727	1,078,862,289	0.7935	0.7960
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,046,739,352	1,048,578,766	0.8536	0.8551
第24特定期間末 (2017年11月10日)	944,076,847	945,657,477	0.8959	0.8974
第25特定期間末 (2018年5月10日)	882,622,419	884,155,888	0.8634	0.8649
第26特定期間末 (2018年11月12日)	824,034,111	825,480,307	0.8547	0.8562
第27特定期間末 (2019年5月10日)	766,179,336	767,537,727	0.8461	0.8476
第28特定期間末 (2019年11月11日)	745,325,595	746,608,415	0.8715	0.8730
第29特定期間末 (2020年5月11日)	618,770,175	619,893,950	0.8259	0.8274

第30特定期間末 (2020年11月10日)	643,652,906	644,740,886	0.8874	0.8889
第31特定期間末 (2021年5月10日)	634,877,275	635,866,223	0.9630	0.9645
第32特定期間末 (2021年11月10日)	628,637,499	629,608,621	0.9710	0.9725
第33特定期間末 (2022年5月10日)	607,273,176	608,248,456	0.9340	0.9355
第34特定期間末 (2022年11月10日)	603,572,869	604,530,886	0.9450	0.9465
第35特定期間末 (2023年5月10日)	598,388,456	599,335,879	0.9474	0.9489
第36特定期間末 (2023年11月10日)	626,928,194	627,865,745	1.0030	1.0045
2023年11月末日	619,225,871	-	1.0208	-
12月末日	620,840,719	-	1.0340	-
2024年1月末日	614,301,489	-	1.0382	-
2月末日	617,140,640	-	1.0529	-
3月末日	616,881,686	-	1.0552	-
4月末日	616,742,595	-	1.0653	-
第37特定期間末 (2024年5月10日)	606,280,642	617,834,111	1.0495	1.0695
5月末日	603,556,418	-	1.0533	-
6月末日	624,868,067	-	1.0872	-
7月末日	591,758,806	-	1.0138	-
8月末日	587,213,681	-	1.0002	-
9月末日	592,374,898	-	1.0020	-
10月末日	605,351,041	-	1.0261	-
第38特定期間末 (2024年11月11日)	597,240,499	603,142,816	1.0119	1.0219
11月末日	586,232,406	-	0.9978	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第19特定期間	0.0105
第20特定期間	0.0095
第21特定期間	0.0075
第22特定期間	0.0075
第23特定期間	0.0045

第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045
第33特定期間	0.0045
第34特定期間	0.0045
第35特定期間	0.0045
第36特定期間	0.0045
第37特定期間	0.0550
第38特定期間	0.0515

【収益率の推移】

	収益率(%)
第19特定期間	4.1
第20特定期間	3.4
第21特定期間	6.5
第22特定期間	4.4
第23特定期間	8.1
第24特定期間	5.5
第25特定期間	3.1
第26特定期間	0.5
第27特定期間	0.5
第28特定期間	3.5
第29特定期間	4.7
第30特定期間	8.0
第31特定期間	9.0
第32特定期間	1.3
第33特定期間	3.3
第34特定期間	1.7
第35特定期間	0.7
第36特定期間	6.3
第37特定期間	10.1
第38特定期間	1.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第19特定期間	29,475,271	272,235,197
第20特定期間	46,300,831	178,366,471
第21特定期間	24,051,624	136,327,052
第22特定期間	10,094,094	66,554,667
第23特定期間	6,086,004	135,234,627
第24特定期間	10,558,332	183,081,271
第25特定期間	12,683,654	44,124,014
第26特定期間	5,144,673	63,327,127
第27特定期間	7,944,020	66,480,539
第28特定期間	4,826,658	55,206,979
第29特定期間	5,358,492	111,388,864
第30特定期間	10,162,525	34,025,491
第31特定期間	5,581,535	71,602,996
第32特定期間	14,180,659	26,064,725
第33特定期間	23,352,696	20,580,867
第34特定期間	32,754,614	44,263,112
第35特定期間	20,401,505	27,464,172
第36特定期間	44,719,491	51,300,597
第37特定期間	13,902,923	61,264,025
第38特定期間	26,009,965	13,451,709

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2024年11月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,978円
純資産総額	5.8億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.8%
3カ月間	0.9%
6カ月間	-0.6%
1年間	8.1%
3年間	18.1%
5年間	30.4%
設定来	106.4%



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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：1,065円 設定来分配金合計額：6,285円

決算期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	23年1月	23年3月	23年5月	23年7月	23年9月	23年11月	24年1月	24年3月	24年5月	24年7月	24年9月	24年11月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	100円	250円	200円	400円	15円	100円

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

主要な資産の状況

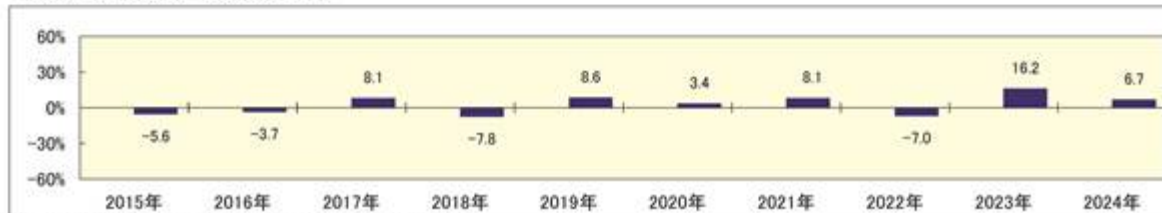
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	43	66.4%	米ドル	24.0%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.5%	
国内株式	88	9.5%	ユーロ	20.7%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	0.5%	
外国株式	162	8.0%	日本円	16.5%	修正デュレーション	住友電工	日本	0.4%	
国内リート・先物	51	4.9%	豪ドル	10.9%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%	
外国リート	70	4.8%	英ポンド	9.8%	債券格付別構成	小松製作所	日本	0.4%	
外国優先出資証券	63	0.5%	カナダドル	6.5%	AAA	73.9%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.4%
			デンマーク・クローネ	2.9%	AA	22.6%	日本ビルファンド	日本	0.3%
			ポーランド・ズロチ	2.6%	A	3.6%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.3%
			チェコ・コルナ	1.4%	BBB	-	日本プロロジスリート	日本	0.3%
コール・ローン、その他		5.9%	その他	4.8%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.2%
合計	477	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.6%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2024年は11月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（2024年11月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,420,942,402	99.18
内 日本	3,420,942,402	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	28,442,156	0.82
純資産総額	3,449,384,558	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11月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	202,713,007	6.0386 1,224,104,122	5.9415 1,204,419,331	34.92
2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	321,271,538	2.1642 695,319,851	2.1381 686,910,675	19.91
3	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	129,844,230	3.1375 407,392,899	3.0608 397,427,219	11.52
4	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	55,185,108	7.3399 405,057,633	7.2013 397,404,518	11.52
5	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	93,729,603	4.4050 412,879,562	4.1693 390,786,833	11.33
6	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	35,975,375	4.7780 171,892,577	4.7991 172,649,422	5.01
7	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	51,173,552	3.3638 172,140,889	3.3483 171,344,404	4.97

(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	99.18%

合計	99.18%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第19特定期間末 (2015年5月11日)	7,225,488,064	7,395,649,150	1.0191	1.0431
第20特定期間末 (2015年11月10日)	6,532,848,494	6,559,720,979	0.9724	0.9764
第21特定期間末 (2016年5月10日)	5,551,044,127	5,576,599,040	0.8689	0.8729
第22特定期間末 (2016年11月10日)	5,116,194,834	5,140,460,598	0.8434	0.8474
第23特定期間末 (2017年5月10日)	5,287,390,510	5,309,662,342	0.9496	0.9536
第24特定期間末 (2017年11月10日)	5,057,631,350	5,077,504,216	1.0180	1.0220
第25特定期間末 (2018年5月10日)	4,653,393,092	4,672,305,292	0.9842	0.9882
第26特定期間末 (2018年11月12日)	4,168,672,375	4,186,518,075	0.9344	0.9384
第27特定期間末 (2019年5月10日)	3,794,279,955	3,811,358,261	0.8887	0.8927
第28特定期間末 (2019年11月11日)	3,761,340,903	3,777,373,246	0.9384	0.9424
第29特定期間末 (2020年5月11日)	3,058,775,631	3,073,722,465	0.8186	0.8226

第30特定期間末 (2020年11月10日)	3,291,713,061	3,306,146,732	0.9122	0.9162
第31特定期間末 (2021年5月10日)	3,395,326,766	3,475,919,783	1.0532	1.0782
第32特定期間末 (2021年11月10日)	3,185,913,394	3,263,859,118	1.0218	1.0468
第33特定期間末 (2022年5月10日)	3,014,446,103	3,026,728,646	0.9817	0.9857
第34特定期間末 (2022年11月10日)	2,994,351,205	3,006,325,092	1.0003	1.0043
第35特定期間末 (2023年5月10日)	3,016,621,443	3,031,263,507	1.0301	1.0351
第36特定期間末 (2023年11月10日)	3,218,382,441	3,233,753,993	1.0469	1.0519
2023年11月末日	3,280,142,985	-	1.0664	-
12月末日	3,304,044,737	-	1.0752	-
2024年1月末日	3,367,219,975	-	1.0886	-
2月末日	3,503,987,767	-	1.1282	-
3月末日	3,491,134,734	-	1.1156	-
4月末日	3,539,547,721	-	1.1270	-
第37特定期間末 (2024年5月10日)	3,412,187,200	3,570,006,696	1.0810	1.1310
5月末日	3,479,562,208	-	1.0872	-
6月末日	3,622,847,245	-	1.1230	-
7月末日	3,426,593,836	-	1.0334	-
8月末日	3,413,989,781	-	1.0174	-
9月末日	3,429,293,637	-	1.0173	-
10月末日	3,530,933,186	-	1.0444	-
第38特定期間末 (2024年11月11日)	3,495,990,225	3,563,874,848	1.0300	1.0500
11月末日	3,449,384,558	-	1.0093	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第19特定期間	0.0620
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120

第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0170
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120
第30特定期間	0.0120
第31特定期間	0.0330
第32特定期間	0.0650
第33特定期間	0.0230
第34特定期間	0.0130
第35特定期間	0.0140
第36特定期間	0.0950
第37特定期間	0.1400
第38特定期間	0.0840

【収益率の推移】

	収益率(%)
第19特定期間	8.6
第20特定期間	3.4
第21特定期間	9.4
第22特定期間	1.6
第23特定期間	14.0
第24特定期間	8.5
第25特定期間	1.7
第26特定期間	3.8
第27特定期間	3.6
第28特定期間	6.9
第29特定期間	11.5
第30特定期間	12.9
第31特定期間	19.1
第32特定期間	3.2
第33特定期間	1.7
第34特定期間	3.2
第35特定期間	4.4
第36特定期間	10.9
第37特定期間	16.6
第38特定期間	3.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第19特定期間	75,174,262	1,155,910,225
第20特定期間	80,486,286	452,410,273
第21特定期間	25,129,059	354,521,879
第22特定期間	35,863,134	358,150,519
第23特定期間	29,786,290	528,269,188
第24特定期間	54,376,920	654,118,402
第25特定期間	42,388,187	282,554,834
第26特定期間	24,330,190	290,955,202
第27特定期間	29,326,275	221,174,687
第28特定期間	27,601,125	289,091,902
第29特定期間	27,702,752	299,080,075
第30特定期間	31,943,313	160,233,931
第31特定期間	24,319,139	409,016,346
第32特定期間	53,510,881	159,402,589
第33特定期間	60,334,741	107,527,878
第34特定期間	57,102,598	134,266,503
第35特定期間	58,018,990	123,078,128
第36特定期間	312,619,516	166,721,757
第37特定期間	223,801,785	141,722,415
第38特定期間	364,517,711	126,676,453

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

2024年11月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,093円
純資産総額	34億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.5%
3カ月間	1.5%
6カ月間	0.3%
1年間	16.2%
3年間	43.0%
5年間	70.4%
設定来	211.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 2,240円 設定来分配金合計額: 10,870円

決算期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	23年1月	23年3月	23年5月	23年7月	23年9月	23年11月	24年1月	24年3月	24年5月	24年7月	24年9月	24年11月
分配金	40円	50円	50円	450円	450円	50円	300円	600円	500円	600円	40円	200円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	88	33.3%	日本円	41.1%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	1.6%	
外国株式	162	29.1%	米ドル	19.5%	最終利回り(%)	東京海上HD	日本	1.6%	
外国債券	43	19.0%	ユーロ	12.9%	修正デュレーション	住友電工	日本	1.5%	
外国リート	70	5.0%	豪ドル	6.9%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.3%	
国内リート・先物	51	4.9%	英ポンド	5.2%	債券格付別構成	小松製作所	日本	1.3%	
外国優先出資証券	63	1.9%	台湾ドル	3.7%	AAA	73.9%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.4%
			カナダドル	2.0%	AA	22.6%	日本ビルファンド	日本	0.3%
			韓国ウォン	1.7%	A	3.6%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.3%
			スイス・フラン	1.6%	BBB	-	日本プロロジスリート	日本	0.3%
コール・ローン、その他	7.0%		その他	5.3%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.2%
合計	477	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	8.9%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

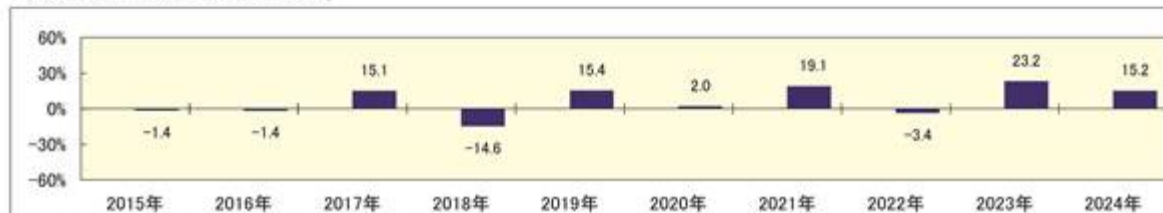
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2024年は11月29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) ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	1.36%	1.32%	0.03%
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	1.45%	1.40%	0.04%
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	1.55%	1.48%	0.07%

※対象期間は2024年5月11日～2024年11月11日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、委託会社および販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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。

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

<一部解約>

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

信託約款の変更

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

反対者の買取請求権

前 1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 2.の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 3.または前 4.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年5月および11月の計算期間の末日ならびに償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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

第3 【ファンドの経理状況】

【安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2024年5月11日から2024年11月11日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,618,354	20,331,690
親投資信託受益証券	908,359,276	873,322,024
流動資産合計	933,977,630	893,653,714
資産合計	933,977,630	893,653,714
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	13,341,955	6,137,594
未払解約金	30,175	1,053,412
未払受託者報酬	84,026	82,315
未払委託者報酬	1,932,933	1,893,648
その他未払費用	37,544	37,656
流動負債合計	15,426,633	9,204,625
負債合計	15,426,633	9,204,625
純資産の部		
元本等		
元本	1,889,463,697	1,876,799,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,087,300	7,649,843
（分配準備積立金）	62,113,895	58,136,614
元本等合計	918,550,997	884,449,089
純資産合計	918,550,997	884,449,089
負債純資産合計	933,977,630	893,653,714

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 2023年11月11日 至 2024年5月10日		自 2024年5月11日 至 2024年11月11日	
営業収益				
受取利息		1,069		8,554
有価証券売買等損益		71,742,942		14,962,748
営業収益合計		71,744,011		14,971,302
営業費用				
支払利息		359		-
受託者報酬		250,845		251,689
委託者報酬		1,577,560		1,578,736
その他費用		37,544		37,656
営業費用合計		6,059,308		6,079,081
営業利益又は営業損失()		65,684,703		8,892,221
経常利益又は経常損失()		65,684,703		8,892,221
当期純利益又は当期純損失()		65,684,703		8,892,221
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		798,736		333,206
期首剰余金又は期首欠損金()		2,664,460		29,087,300
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,644,649		1,761,268
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,644,649		1,761,268
剰余金減少額又は欠損金増加額		713,466		2,417,884
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		713,466		2,417,884
分配金		2,34,065,390		2,30,006,268
期末剰余金又は期末欠損金()		29,087,300		7,649,843

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期
	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2024年11月10日が休日のため、当特定期間末日を2024年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首元本額	844,809,483円	889,463,697円
期中追加設定元本額	105,110,672円	58,529,876円
期中一部解約元本額	60,456,458円	71,194,327円
2. 特定期間末日における受益権の総数	889,463,697口	876,799,246口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	自2023年11月11日 至2024年5月10日	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	261,128円	258,714円

2. 2 分配金の計算過程

<p>(自2023年11月11日至2024年1月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,072,681円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(19,105,229円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,337,890円)及び分配準備積立金(35,205,159円)より分配対象額は80,720,959円(1万口当たり892.91円)であり、うち7,232,197円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年5月11日至2024年7月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,596,166円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(22,449,179円)、投資信託約款に規定される収益調整金(26,936,798円)及び分配準備積立金(60,925,860円)より分配対象額は113,908,003円(1万口当たり1,262.36円)であり、うち22,558,556円(1万口当たり250円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2024年1月11日至2024年3月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,159,486円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(14,245,200円)、投資信託約款に規定される収益調整金(24,316,565円)及び分配準備積立金(48,817,032円)より分配対象額は90,538,283円(1万口当たり1,006.63円)であり、うち13,491,238円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年7月11日至2024年9月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,344,847円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(27,607,655円)及び分配準備積立金(60,834,474円)より分配対象額は89,786,976円(1万口当たり1,028.00円)であり、うち1,310,118円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2024年3月12日至2024年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,249,911円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(19,458,423円)、投資信託約款に規定される収益調整金(24,462,651円)及び分配準備積立金(51,747,516円)より分配対象額は99,918,501円(1万口当たり1,123.36円)であり、うち13,341,955円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年9月11日至2024年11月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,614,400円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(28,163,684円)及び分配準備積立金(60,659,808円)より分配対象額は92,437,892円(1万口当たり1,054.27円)であり、うち6,137,594円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
--	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	当期 自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期
	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	24,678,649	20,493,436
合計	24,678,649	20,493,436

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期	当期
2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期
自2024年5月11日
至2024年11月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0327円 (10,327円)	1.0087円 (10,087円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	141,624,302	306,531,639	
	ダイワ日本国債マザーファンド	253,949,489	308,751,788	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	8,894,180	42,495,502	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	14,842,366	89,628,595	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	3,942,864	28,940,621	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	8,635,772	27,105,961	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	6,374,053	28,089,176	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	12,418,257	41,778,742	
親投資信託受益証券 合計			873,322,024	
合計			873,322,024	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	309,779,744	352,940,387
コール・ローン	30,581,408	43,011,411
国債証券	13,304,425,903	13,192,772,836
特殊債券	2,421,283,007	1,949,804,328
派生商品評価勘定	18,900	26,265
未収利息	105,566,233	109,760,863
前払費用	18,438,211	287,429
差入委託証拠金	184,134,805	184,186,197
流動資産合計	16,374,228,211	15,832,789,716
資産合計	16,374,228,211	15,832,789,716
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,103,773	8,800,737
流動負債合計	26,103,773	8,800,737
負債合計	26,103,773	8,800,737
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,632,078,055	7,310,900,594
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,716,046,383	8,513,088,385
元本等合計	16,348,124,438	15,823,988,979
純資産合計	16,348,124,438	15,823,988,979

負債純資産合計	16,374,228,211	15,832,789,716
---------	----------------	----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)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>(2)先物オプション取引</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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	8,336,994,685円	7,632,078,055円
期中追加設定元本額	125,277,852円	169,107,004円
期中一部解約元本額	830,194,482円	490,284,465円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,034,998,143円	971,308,175円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	463,776,960円	438,690,354円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	149,133,647円	141,624,302円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	196,490,507円	191,203,498円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	315,432,505円	315,708,673円
6 資産バランスファンド（分配型）	628,744,051円	615,542,527円
6 資産バランスファンド（成長型）	99,451,602円	99,046,103円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	2,900,680,401円	2,740,908,706円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	35,032,054円	-円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	118,657,438円	111,129,764円

兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	660,525,636円	705,350,421円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	560,873,661円	531,342,936円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	11,107,731円	11,322,148円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年1回決算型)	381,290,411円	368,928,544円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年2回決算型)	75,883,308円	68,794,443円
計	7,632,078,055円	7,310,900,594円
2. 期末日における受益権の総数	7,632,078,055口	7,310,900,594口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってデリバティブ取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	103,383,711	132,785,556
特殊債券	10,895,021	7,184,025
合計	114,278,732	139,969,581

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年5月10日現在				2024年11月11日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	113,749,900	-	113,731,000	18,900	41,848,642	-	41,822,377	26,265
カナダ・ドル	113,749,900	-	113,731,000	18,900	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	41,848,642	-	41,822,377	26,265
合計	113,749,900	-	113,731,000	18,900	41,848,642	-	41,822,377	26,265

(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5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	2.1420円	2.1644円
(1万口当たり純資産額)	(21,420円)	(21,644円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	900,000.000	608,796.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	2,100,000.000	1,993,425.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	4,763,167.920	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	16,600,400.000	13,698,484.070	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,600,000.000	1,674,088.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,400,000.000	3,180,768.000	
アメリカ・ドル 小計				25,918,728.990 (3,969,194,158)	
イギリス・ポンド		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	2,520,000.000	2,406,549.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,910,240.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	539,532.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,386,660.870	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	835,200.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	913,870.000	
イギリス・ポンド 小計				9,992,052.470 (1,975,928,376)	
オーストラリア・ドル		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	9,000,000.000	9,003,330.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	6,000,000.000	3,131,160.000	
オーストラリア・ドル 小計				12,134,490.000 (1,224,370,041)	
カナダ・ドル		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,567,170.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	2,200,000.000	2,030,842.000	

	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	3,754,000.000	3,224,761.080	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	923,950.000	
カナダ・ドル 小計			7,746,723.080 (852,681,810)	
スウェーデン・ クローナ	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	8,230,000.000	8,094,122.700	
スウェーデン・クローナ 小計			8,094,122.700 (114,531,837)	
チェコ・コルナ	1% Czech Republic Government Bond 20260626	30,000,000.000	28,805,400.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	15,000,000.000	16,285,350.000	
チェコ・コルナ 小計			45,090,750.000 (292,918,530)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	7,012,390.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	20,156,166.000	
デンマーク・クローネ 小計			27,168,556.000 (597,708,232)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	17,000,000.000	16,849,040.000	
ノルウェー・クローネ 小計			16,849,040.000 (234,370,147)	
ポーランド・ズ ロチ	0.75% Poland Government Bond 20250425	100,000.000	98,658.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,500,000.000	4,355,395.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	485,905.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	10,000,000.000	9,266,600.000	
ポーランド・ズロチ 小計			14,206,558.000 (538,384,508)	
ユーロ	FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	500,000.000	403,165.000	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,059,122.000	

		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	600,000.000	596,172.000	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	7,400,000.000	6,630,326.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	8,801,256.960	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	2,600,000.000	1,881,100.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	450,000.000	310,918.500	
	ユーロ 小計			20,682,060.460 (3,392,685,197)	
国債証券 合計				13,192,772,836 [13,192,772,836]	
特殊債券	オーストラリア・ドル	4.3% SWEDISH EXPORT CREDIT 20280530	800,000.000	789,160.000	
		1.25% INTL. FIN. CORP. 20310206	5,600,000.000	4,535,216.000	
		1.1% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20261216	2,500,000.000	2,332,575.000	
	オーストラリア・ドル 小計			7,656,951.000 (772,586,356)	
	カナダ・ドル	3.55% CANADA HOUSING TRUST 20320915	3,000,000.000	3,016,890.000	
		3.65% CANADA HOUSING TRUST 20330615	2,400,000.000	2,426,472.000	
	カナダ・ドル 小計			5,443,362.000 (599,150,855)	
	ユーロ	2.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20300730	3,500,000.000	3,523,940.000	
	ユーロ 小計			3,523,940.000 (578,067,117)	
特殊債券 合計				1,949,804,328 [1,949,804,328]	
合計				15,142,577,164 [15,142,577,164]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 6銘柄	100%	26.3%
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	100%	13.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄 特殊債券 3銘柄	100%	13.2%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄 特殊債券 2銘柄	100%	9.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	100%	0.8%
チェコ・コルナ	国債証券 2銘柄	100%	1.9%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	3.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	1.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 4銘柄	100%	3.6%
ユーロ	国債証券 7銘柄 特殊債券 1銘柄	100%	26.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	510,655,524	131,393,840
国債証券	84,225,997,890	75,574,723,210
未収入金	-	415,204,000
未収利息	289,206,598	245,893,472
前払費用	1,816,980	2,820,544

流動資産合計		85,027,676,992	76,370,035,066
資産合計		85,027,676,992	76,370,035,066
負債の部			
流動負債			
未払解約金		26,784,700	52,679,880
流動負債合計		26,784,700	52,679,880
負債合計		26,784,700	52,679,880
純資産の部			
元本等			
元本	1	69,882,591,325	62,771,738,364
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		15,118,300,967	13,545,616,822
元本等合計		85,000,892,292	76,317,355,186
純資産合計		85,000,892,292	76,317,355,186
負債純資産合計		85,027,676,992	76,370,035,066

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	78,589,772,982円	69,882,591,325円
期中追加設定元本額	633,054,268円	290,590,318円
期中一部解約元本額	9,340,235,925円	7,401,443,279円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	260,526,236円	253,949,489円
6資産バランスファンド（分配型）	212,746,275円	211,126,317円
6資産バランスファンド（成長型）	169,124,729円	170,765,592円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	63,872,251,835円	57,405,838,409円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	56,288,185円	-円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	5,305,411,746円	4,712,583,797円
目標利回り追求型債券ファンド	6,242,319円	17,474,760円
計	69,882,591,325円	62,771,738,364円
2. 期末日における受益権の総数	69,882,591,325口	62,771,738,364口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,005,320,370	1,601,755,850
合計	1,005,320,370	1,601,755,850

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.2163円	1.2158円
(1万口当たり純資産額)	(12,163円)	(12,158円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
----	----	------	------------	----

国債証券	1 30年国債	1,350,000,000	1,489,050,000	
	12 30年国債	2,400,000,000	2,651,400,000	
	14 30年国債	1,900,000,000	2,149,508,000	
	16 30年国債	2,600,000,000	2,967,146,000	
	18 30年国債	1,500,000,000	1,683,690,000	
	20 30年国債	2,900,000,000	3,314,584,000	
	22 30年国債	2,000,000,000	2,287,140,000	
	24 30年国債	2,400,000,000	2,743,728,000	
	26 30年国債	4,400,000,000	4,978,644,000	
	28 30年国債	2,400,000,000	2,741,664,000	
	29 30年国債	2,000,000,000	2,255,620,000	
	30 30年国債	4,500,000,000	5,007,870,000	
	75 20年国債	3,374,000,000	3,397,044,420	
	80 20年国債	1,673,000,000	1,691,620,490	
	86 20年国債	3,400,000,000	3,486,054,000	
	88 20年国債	1,460,000,000	1,502,967,800	
	94 20年国債	3,600,000,000	3,735,540,000	
	95 20年国債	1,205,000,000	1,261,369,900	
	101 20年国債	4,760,000,000	5,054,691,600	
	106 20年国債	100,000,000	106,208,000	
	110 20年国債	3,300,000,000	3,512,091,000	
	116 20年国債	2,800,000,000	3,030,664,000	
	121 20年国債	1,900,000,000	2,037,389,000	
	125 20年国債	2,600,000,000	2,848,378,000	
130 20年国債	2,000,000,000	2,148,100,000		
134 20年国債	2,400,000,000	2,583,648,000		
140 20年国債	2,300,000,000	2,462,978,000		
143 20年国債	2,300,000,000	2,445,935,000		
国債証券 合計		75,574,723,210		
合計		75,574,723,210		

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	233,481,454	1,311,909,054
コール・ローン	987,712,834	843,129,422
投資証券	97,408,805,595	99,368,821,141
派生商品評価勘定	164,583	-
未収入金	1,562,667,586	247,592,263
未収配当金	105,755,121	93,188,052
流動資産合計	100,298,587,173	101,864,639,932
資産合計	100,298,587,173	101,864,639,932
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	205,859	-
未払金	937,352,108	115,229,789
未払解約金	81,000,000	61,561,000
流動負債合計	1,018,557,967	176,790,789
負債合計	1,018,557,967	176,790,789
純資産の部		
元本等		
元本	1 22,669,949,304	21,282,974,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	76,610,079,902	80,404,875,143
元本等合計	99,280,029,206	101,687,849,143
純資産合計	99,280,029,206	101,687,849,143
負債純資産合計	100,298,587,173	101,864,639,932

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11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>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> <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5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1期首	2023年11月11日	2024年5月11日

期首元本額	24,224,310,684円	22,669,949,304円
期中追加設定元本額	530,450,372円	373,232,251円
期中一部解約元本額	2,084,811,752円	1,760,207,555円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
グローバルREIT・オープン (適格機関投資家専用)	814,896円	812,370円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(毎月分配型)	17,028,587,240円	15,828,860,071円
安定重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	10,622,026円	8,894,180円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	6,889,034円	6,029,236円
成長重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	39,233,083円	35,558,002円
6資産バランスファンド(分配 型)	62,566,207円	56,051,763円
6資産バランスファンド(成長 型)	201,324,429円	181,485,196円
りそな ワールド・リート・ファ ンド	837,178,724円	759,969,419円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	17,657,299円	-円
常陽3分法ファンド	81,874,843円	-円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	20,008,720円	16,998,393円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(為替ヘッジあり/毎 月分配型)	35,079,565円	28,039,873円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(為替ヘッジなし/資 産成長型)	781,208,814円	959,230,552円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(為替ヘッジあり/資 産成長型)	828,572,359円	808,424,917円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(為替ヘッジなし/奇 数月決算型)	3,315,233円	6,350,877円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	369,236,628円	343,246,853円

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	495,020,628円	469,933,662円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	805,305,059円	768,771,985円
グローバルREITファンド 2021-07(適格機関投資家専用)	816,572,408円	811,338,176円
ライフハーモニー(ダイワ世界 資産分散ファンド)(分配型)	192,397,394円	160,435,953円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り)	13,274,430円	11,842,564円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	23,210,285円	20,699,958円
計	22,669,949,304円	21,282,974,000円
2. 期末日における受益権の総数	22,669,949,304口	21,282,974,000口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	1,249,991,771	4,674,479,325
合計	1,249,991,771	4,674,479,325

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年5月10日現在				2024年11月11日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	369,022,528	-	368,857,945	164,583	-	-	-	-
アメリカ・ドル	136,066,071	-	136,004,373	61,698	-	-	-	-
イギリス・ポンド	232,956,457	-	232,853,572	102,885	-	-	-	-

買建	369,022,528	-	368,816,669	205,859	-	-	-	-
アメリカ・ドル	232,956,457	-	232,871,777	84,680	-	-	-	-
ユーロ	136,066,071	-	135,944,892	121,179	-	-	-	-
合計	738,045,056	-	737,674,614	41,276	-	-	-	-

(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5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	4,3794円	4,7779円
(1万口当たり純資産額)	(43,794円)	(47,779円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,410	5,004,587.500	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	122,487	21,927,622.740	

	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,660	3,954,427.200	
	EQUINIX INC	17,959	16,541,316.540	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	640,201	11,530,020.010	
	KIMCO REALTY CORP	460,373	11,477,098.890	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	510,886	9,083,553.080	
	INVITATION HOMES INC	470,607	15,859,455.900	
	LAMAR ADVERTISING CO-A	19,533	2,511,553.140	
	AMERICOLD REALTY TRUST	200,890	4,572,256.400	
	VICI PROPERTIES INC	467,981	14,689,923.590	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	54,292	2,340,528.120	
	DIGITAL CORE REIT UNITS	14,013,656	8,127,920.480	
	WEYERHAEUSER CO	184,187	5,873,723.430	
	CROWN CASTLE INTL CORP	127,309	13,475,657.650	
	LINEAGE INC	18,646	1,255,248.720	
	CURLINE PROPERTIES	85,659	2,084,940.060	
	IRON MOUNTAIN INC	102,731	12,297,928.010	
	SUN COMMUNITIES INC	92,115	11,543,851.800	
	PROLOGIS INC	216,849	25,117,619.670	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	22,946	4,038,496.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,160	8,274,565.600	
	WELLTOWER INC	233,943	32,330,922.600	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	91,255	3,083,506.450	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	93,589	6,685,062.270	
	REALTY INCOME CORP	137,179	7,889,164.290	
	PUBLIC STORAGE	43,378	14,723,360.760	
	UDR INC	288,183	12,818,379.840	
	AGREE REALTY CORP	90,795	6,883,168.950	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	161,908	6,694,895.800	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	177,229	32,252,133.420	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	80,286	13,463,962.200	
	アメリカ・ドル 小計		348,406,851.110 (53,355,025,179)	
イギリス・ポンド	HAMMERSON REIT PLC	647,281	1,869,347.520	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,916,286	2,142,407.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,175,507	6,970,756.510	
	SEGRO PLC	1,252,963	9,773,111.400	

	UNITE GROUP PLC/THE	583,604	5,045,256.580	
	DERWENT LONDON PLC	170,868	3,690,748.800	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	536,499	4,289,309.500	
	BIG YELLOW GROUP PLC	448,361	5,407,233.660	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,319,722	8,259,308.460	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,152,549	7,131,127.810	
イギリス・ポンド 小計			54,578,607.980 (10,792,919,728)	
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	5,539,768	13,683,226.960	
	GPT GROUP	2,522,764	11,428,120.920	
	MIRVAC GROUP	7,349,987	15,434,972.700	
	STOCKLAND	4,659,006	23,481,390.240	
	GOODMAN GROUP	2,153,784	76,890,088.800	
	CHARTER HALL GROUP	1,209,999	18,137,885.010	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,909,005	14,108,674.250	
オーストラリア・ドル 小計			173,164,358.880 (17,472,283,811)	
カナダ・ドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	913,132	11,852,453.360	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	80,292	3,637,227.600	
カナダ・ドル 小計			15,489,680.960 (1,704,949,183)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,320,000	16,390,400.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,920,200	3,737,856.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	4,126,300	8,706,493.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,348,177	15,609,955.430	
シンガポール・ドル 小計			44,444,704.430 (5,128,029,996)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,424,038	9,224,119.230	
ニュージーランド・ドル 小計			9,224,119.230 (842,715,532)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	118,946	8,794,867.240	
	ARGAN	20,122	1,368,296.000	
	GECINA SA	86,566	8,440,185.000	
	KLEPIERRE	450,661	12,942,983.920	
	MERCIALYS	558,318	5,823,256.740	

	AEDIFICA	107,637	6,323,673.750	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	180,357	3,823,568.400	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	373,484	3,798,332.280	
	ユーロ 小計		51,315,163.330 (8,417,739,393)	
香港・ドル	LINK REIT	2,308,192	84,018,188.800	
	香港・ドル 小計		84,018,188.800 (1,655,158,319)	
投資証券 合計			99,368,821,141 [99,368,821,141]	
合計			99,368,821,141 [99,368,821,141]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 32銘柄	100%	53.6%
イギリス・ポンド	投資証券 10銘柄	100%	10.9%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	17.6%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	1.7%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	5.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.8%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	8.5%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,215,126,732	1,020,014,361
株式	40,559,236,630	43,339,174,990
未収入金	312,273,719	479,248,703
未収配当金	549,473,117	633,488,399
前払金	10,250,000	-
差入委託証拠金	29,846,901	48,013,291
流動資産合計	42,676,207,099	45,519,939,744
資産合計	42,676,207,099	45,519,939,744
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,972,100	865,400
前受金	-	270,000
未払金	234,084,424	739,100
未払解約金	22,273,000	13,014,000
流動負債合計	262,329,524	14,888,500
負債合計	262,329,524	14,888,500
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,294,057,476	7,535,580,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	35,119,820,099	37,969,471,172
元本等合計	42,413,877,575	45,505,051,244
純資産合計	42,413,877,575	45,505,051,244
負債純資産合計	42,676,207,099	45,519,939,744

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11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5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2023年11月11日 6,517,186,807円 1,225,885,294円 449,014,625円	2024年5月11日 7,294,057,476円 751,384,125円 509,861,529円
期末元本額の内訳 ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	5,721,761,645円	5,936,875,372円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	15,594,958円	14,842,366円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,257,413円	9,973,367円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	201,245,159円	204,197,303円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	29,551,845円	27,862,747円

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	184,201,165円	186,332,199円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	378,226,461円	379,928,789円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	753,218,830円	775,567,929円
計	7,294,057,476円	7,535,580,072円
2. 期末日における受益権の総数	7,294,057,476口	7,535,580,072口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	511,163,601	606,547,668
合計	511,163,601	606,547,668

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年5月10日現在				2024年11月11日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	606,340,000	-	600,380,000	5,960,000	768,330,000	-	767,480,000	850,000
合計	606,340,000	-	600,380,000	5,960,000	768,330,000	-	767,480,000	850,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	5,8149円	6,0387円
（1万口当たり純資産額）	（58,149円）	（60,387円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ニッスイ	239,600	952.00	228,099,200	
日鉄鉱業	20,600	4,235.00	87,241,000	
コムシスホールディングス	24,500	3,172.00	77,714,000	
大林組	493,200	2,038.00	1,005,141,600	
鹿島建設	168,000	2,735.50	459,564,000	
大東建託	51,200	17,115.00	876,288,000	
住友林業	78,000	5,819.00	453,882,000	
積水ハウス	141,000	3,660.00	516,060,000	
UTグループ	89,100	2,650.00	236,115,000	
コカ・コーラボトラーズJHD	69,600	2,304.50	160,393,200	
日清オイリオグループ	57,500	5,060.00	290,950,000	
パルグループHLDGS	80,500	3,030.00	243,915,000	
日本たばこ産業	110,300	4,203.00	463,590,900	
グンゼ	76,300	5,200.00	396,760,000	
ダイワボウHD	279,500	3,157.00	882,381,500	
東急不動産HD	448,800	961.80	431,655,840	
共和レザー	80,600	632.00	50,939,200	
コーエーテクモHD	169,700	1,632.00	276,950,400	
日産化学	85,900	5,299.00	455,184,100	

日本曹達	90,800	2,466.00	223,912,800	
東ソー	100,500	2,046.00	205,623,000	
東亜合成	276,800	1,541.00	426,548,800	
三菱瓦斯化学	116,500	2,734.00	318,511,000	
リケンテクノス	82,300	1,096.00	90,200,800	
日本精化	29,600	2,425.00	71,780,000	
武田薬品	186,800	4,192.00	783,065,600	
中国塗料	69,200	2,622.00	181,442,400	
サワイグループHD	159,300	2,028.50	323,140,050	
富士フイルムHLDGS	130,000	3,474.00	451,620,000	
コスモエネルギーHLDGS	136,800	7,220.00	987,696,000	
TOYO TIRE	207,500	2,146.00	445,295,000	
日本製鉄	57,600	3,170.00	182,592,000	
大紀アルミニウム	247,800	1,085.00	268,863,000	
住友電工	680,000	2,702.50	1,837,700,000	
フジクラ	62,800	5,908.00	371,022,400	
AREホールディングス	115,100	1,871.00	215,352,100	
高周波熱錬	89,100	989.00	88,119,900	
マルゼン	58,700	3,200.00	187,840,000	
日本発条	175,400	1,897.00	332,733,800	
ツガミ	181,000	1,375.00	248,875,000	
オーエスジー	65,000	1,794.50	116,642,500	
ベルシステム24HLDGS	179,200	1,289.00	230,988,800	
小松製作所	405,900	4,204.00	1,706,403,600	
C K D	1,100	2,673.00	2,940,300	
S A N K Y O	490,200	2,118.00	1,038,243,600	
竹内製作所	25,200	5,030.00	126,756,000	
日本精工	543,500	677.10	368,003,850	
日立	297,300	4,095.00	1,217,443,500	
富士電機	21,800	8,766.00	191,098,800	
ダイヘン	73,700	7,240.00	533,588,000	
マクセル	6,400	1,771.00	11,334,400	
芝浦電子	24,000	3,535.00	84,840,000	
三菱重工業	198,700	2,326.00	462,176,200	
I H I	39,300	9,175.00	360,577,500	
いすゞ自動車	178,400	1,860.50	331,913,200	
トヨタ自動車	365,200	2,653.50	969,058,200	
新明和工業	128,600	1,369.00	176,053,400	
プレス工業	188,000	546.00	102,648,000	
アイシン	369,600	1,608.00	594,316,800	

本田技研	848,000	1,379.50	1,169,816,000	
萩原電気HLDGS	30,900	3,225.00	99,652,500	
ネットワンシステムズ	74,100	4,540.00	336,414,000	
ダイトロン	80,100	2,790.00	223,479,000	
キヤノン	104,600	5,044.00	527,602,400	
日本紙パルプ	239,000	647.00	154,633,000	
東京エレクトロン	15,800	23,260.00	367,508,000	
B I P R O G Y	100,600	4,628.00	465,576,800	
三菱商事	505,300	2,721.50	1,375,173,950	
阪和興業	58,200	4,945.00	287,799,000	
丸井グループ	219,700	2,398.00	526,840,600	
三菱UFJフィナンシャルG	961,300	1,763.00	1,694,771,900	
三井住友トラストグルー	263,900	3,593.00	948,192,700	
三井住友フィナンシャルG	573,600	3,547.00	2,034,559,200	
ふくおかフィナンシャルG	55,300	3,843.00	212,517,900	
山陰合同銀行	200,300	1,251.00	250,575,300	
SBIホールディングス	34,000	3,535.00	120,190,000	
オリックス	132,700	3,402.00	451,445,400	
M S & A D	274,000	3,631.00	994,894,000	
東京海上HD	371,900	5,963.00	2,217,639,700	
センコーグループHLDGS	110,700	1,461.00	161,732,700	
セイノーホールディングス	292,100	2,362.50	690,086,250	
九州旅客鉄道	96,800	3,967.00	384,005,600	
三菱倉庫	422,300	1,025.50	433,068,650	
上組	7,300	3,107.00	22,681,100	
日本電信電話	2,975,500	151.20	449,895,600	
K D D I	241,400	4,898.00	1,182,377,200	
光通信	4,700	31,870.00	149,789,000	
九州電力	336,000	1,650.00	554,400,000	
大阪瓦斯	94,700	3,285.00	311,089,500	
乃村工藝社	104,900	772.00	80,982,800	
合計			43,339,174,990	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	167,807,610	316,593,106
コール・ローン	33,777,668	17,399,757
株式	5,084,428,545	5,560,310,719
優先出資証券	1,122,850,811	1,230,723,157
投資証券	78,453,025	69,256,464
未収入金	29,332,196	-
未収配当金	4,362,121	2,922,568
未収利息	2,493,017	2,359,667
流動資産合計	6,523,504,993	7,199,565,438
資産合計	6,523,504,993	7,199,565,438
負債の部		
流動負債		
未払金	16,730,426	-
未払解約金	1,222,000	11,485,000
流動負債合計	17,952,426	11,485,000
負債合計	17,952,426	11,485,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 985,922,777	979,300,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,519,629,790	6,208,780,015
元本等合計	6,505,552,567	7,188,080,438
純資産合計	6,505,552,567	7,188,080,438
負債純資産合計	6,523,504,993	7,199,565,438

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)優先出資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	1,019,974,251円	985,922,777円
期中追加設定元本額	6,840,718円	53,733,130円
期中一部解約元本額	40,892,192円	60,355,484円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,503,322円	3,942,864円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,905,866円	2,641,023円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	60,060,980円	56,280,904円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	8,625,771円	7,629,224円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）	128,077,305円	125,093,533円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）	259,189,650円	257,387,197円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	522,559,883円	526,325,678円
計	985,922,777円	979,300,423円
2. 期末日における受益権の総数	985,922,777口	979,300,423口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	84,498,981	117,435,937
優先出資証券	1,680,363	2,540,410
投資証券	173,964	698,591
合計	82,992,582	114,196,936

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	6,5984円	7,3400円
(1万口当たり純資産額)	(65,984円)	(73,400円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	ABBOTT LABORATORIES	2,040	116.590	237,843.600	
	ADOBE INC	698	494.680	345,286.640	
	ALLIANT ENERGY CORP	2,381	57.750	137,502.750	
	DANAHER CORP	1,117	245.390	274,100.630	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,911	156.420	455,338.620	
	APPLE INC	10,434	226.960	2,368,100.640	
	BECTON DICKINSON AND CO	1,084	231.640	251,097.760	
	NISOURCE INC	5,175	35.970	186,144.750	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	5,322	77.060	410,113.320	
	JPMORGAN CHASE & CO	2,957	236.980	700,749.860	
	CADENCE DESIGN SYS INC	676	301.250	203,645.000	
	SERVICENOW INC	465	1,008.080	468,757.200	
	CATERPILLAR INC	875	393.370	344,198.750	
	MORGAN STANLEY	2,853	129.530	369,549.090	
	BROADCOM INC	4,926	183.640	904,610.640	
	CONSOLIDATED EDISON INC	561	98.130	55,050.930	
	COSTCO WHOLESALE CORP	492	943.800	464,349.600	
	CUMMINS INC	1,061	356.460	378,204.060	
	CSX CORP	11,875	36.000	427,500.000	
	AMAZON.COM INC	7,695	208.180	1,601,945.100	
EXXON MOBIL CORP	4,302	121.110	521,015.220		
EQT CORP	5,741	41.220	236,644.020		
FORD MOTOR CO	10,281	10.970	112,782.570		

NEXTERA ENERGY INC	1,151	76.970	88,592.470	
FREEPORT-MCMORAN INC	4,484	46.360	207,878.240	
FASTENAL CO	4,145	83.330	345,402.850	
GENERAL MOTORS CO	6,492	55.580	360,825.360	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	848	589.260	499,692.480	
ALPHABET INC-CL A	7,057	178.350	1,258,615.950	
HOME DEPOT INC	1,091	405.900	442,836.900	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	22,734	17.290	393,070.860	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	6,688	22.040	147,403.520	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,049	213.720	437,912.280	
JOHNSON & JOHNSON	2,347	155.470	364,888.090	
ELI LILLY & CO	478	831.540	397,476.120	
MCDONALD'S CORP	1,872	298.970	559,671.840	
3M CO	2,116	134.340	284,263.440	
META PLATFORMS INC CLASS A	2,037	589.340	1,200,485.580	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,166	77.490	167,843.340	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	899	504.600	453,635.400	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,114	272.140	303,163.960	
MERCK & CO. INC.	3,333	102.920	343,032.360	
NIKE INC -CL B	3,011	75.880	228,474.680	
NEWMONT CORP	5,654	45.040	254,656.160	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,746	126.240	346,655.040	
EVERGY INC	3,168	62.510	198,031.680	
PFIZER INC	1,976	26.720	52,798.720	
DOW INC	3,301	46.490	153,463.490	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,093	167.710	183,307.030	
PEPSICO INC	1,508	165.110	248,985.880	
NUTRIEN LTD	2,213	48.320	106,932.160	
CHEVRON CORP	1,071	156.930	168,072.030	
TESLA INC	1,608	321.220	516,521.760	
AT&T INC	22,493	22.340	502,493.620	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,950	132.440	258,258.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	623	615.810	383,649.630	
ELEVANCE HEALTH INC	284	422.620	120,024.080	
WALT DISNEY CO/THE	2,140	99.020	211,902.800	
WASTE MANAGEMENT INC	1,943	224.120	435,465.160	
WALMART INC	3,951	84.830	335,163.330	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,167	316.300	369,122.100	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,552	307.870	477,814.240	

	PPL CORP	5,251	33.060	173,598.060	
	NVIDIA CORP	16,551	147.630	2,443,424.130	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	563	551.740	310,629.620	
	MASTERCARD INC - A	761	524.760	399,342.360	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	402	567.620	228,183.240	
	BANK OF AMERICA CORP	10,625	45.130	479,506.250	
	ANALOG DEVICES INC	1,373	225.800	310,023.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	2,062	147.950	305,072.900	
	BUNGE GLOBAL LTD	1,781	87.120	155,160.720	
	EATON CORP PLC	1,546	366.670	566,871.820	
	APPLIED MATERIALS INC	1,577	192.030	302,831.310	
	GILEAD SCIENCES INC	3,517	96.565	339,619.100	
	LABCORP HOLDINGS	1,117	242.390	270,749.630	
	CARDINAL HEALTH INC	2,165	120.560	261,012.400	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,772	81.200	225,086.400	
	MICROSOFT CORP	5,491	422.540	2,320,167.140	
	MEDTRONIC PLC	3,661	87.720	321,142.920	
	CHUBB LTD	1,474	281.360	414,724.640	
	PAYPAL HOLDINGS INC	2,715	83.010	225,372.150	
	BALL CORP	2,347	60.260	141,430.220	
	COMCAST CORP-CLASS A	6,695	43.910	293,977.450	
アメリカ・ドル 小計				35,750,939.240 (5,474,898,835)	
カナダ・ドル	TOURMALINE OIL CORP	4,994	62.290	311,076.260	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	9,773	47.570	464,901.610	
カナダ・ドル 小計				775,977.870 (85,411,884)	
合計				5,560,310,719 [5,560,310,719]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
優先出資 証券	アメリカ・ドル	SCE TRUST IV FR	2,828	70,332.360	
		SCE TRUST V 5.45 K	5,964	149,577.120	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	8,412	213,244.200	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	1,982	45,486.900	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.625 Y	3,572	89,585.760	

AT&T INC 5.35	7,994	193,694.620	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	5,459	138,331.060	
METLIFE INC 5.625 E	1,742	43,637.100	
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	5,987	150,632.920	
US BANCORP 5.5 K	1,776	44,684.160	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	8,159	208,054.500	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	10,922	279,712.420	
CMS ENERGY CORP 5.875	12,484	313,660.500	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	2,220	55,699.800	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,285	32,317.750	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 19- A FR	5,892	151,129.800	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100	27,929.000	
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	7,580	185,331.000	
ALLSTATE CORP 5.1 H	1,861	43,324.080	
SEMPRA 5.75	6,407	160,815.700	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	1,761	39,023.760	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.125	4,604	105,569.720	
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.1	5,824	136,864.000	
METLIFE INC 4.75 F	2,024	44,932.800	
SOUTHERN CO 4.95 2020	3,530	80,272.200	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	10,247	217,133.930	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	12,915	327,782.700	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	6,948	148,826.160	
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2,769	66,732.900	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 4.5	5,300	108,438.000	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	1,116	21,349.080	
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	11,784	249,820.800	

US BANCORP 3.75 L	3,800	67,982.000	
BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN	2,066	41,774.520	
EQUITABLE HOLDINGS INC 4.3 C	1,317	25,260.060	
BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	3,591	68,372.640	
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	1,056	21,183.360	
US BANCORP 4 M	1,142	21,812.200	
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	4,151	88,333.280	
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	6,122	134,194.240	
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2	3,343	66,793.140	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD 4.2	2,430	45,270.900	
BANK OF AMERICA CORP 4.75	5,718	125,738.820	
US BANCORP 4.5	4,012	87,301.120	
WESCO INTERNATIONAL INC FR	2,467	64,487.380	
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	3,545	94,580.600	
KEY FR	6,286	159,287.240	
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	7,681	161,224.190	
RGA FR	10,721	289,574.210	
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	6,169	177,482.130	
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I FR	3,250	88,595.000	
ALLSTATE CORP 7.375	3,154	87,586.580	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625	11,364	311,828.160	
SCE TRUST 7 7.5	11,053	303,625.910	
F&G ANNUITIES & LIFE INC 7.95	3,815	104,912.500	
TPG OPERATING GROUP II LP 6.95	1,643	43,243.760	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC. 6.75	8,081	209,217.090	

		M T BK DEP INT PERP PFD STK SER J 7.5	8,119	226,601.290	
		MORGAN STANLEY 6.625	4,958	133,171.880	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	7,299	184,664.700	
		MOMORGAN STANLEY FR	5,111	129,359.410	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	12,915	329,203.350	
	アメリカ・ドル 小計			8,036,588.460 (1,230,723,157)	
優先出資証券 合計				1,230,723,157 [1,230,723,157]	
投資証券	アメリカ・ドル	DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7,569	189,830.520	
		PUBLIC STORAGE 4.625 L	7,223	157,605.860	
		PUBLIC STORAGE 3.9 0	5,704	104,806.430	
	アメリカ・ドル 小計			452,242.810 (69,256,464)	
投資証券 合計				69,256,464 [69,256,464]	
合計				1,299,979,621 [1,299,979,621]	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 優先出資 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 83銘柄	80.8%	18.2%	1.0%	98.8%
	優先出資証券 62銘柄				
	投資証券 3銘柄				
カナダ・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	-%	1.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額(円)	2024年11月11日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	35,631,265	79,733,705
コール・ローン	16,248,551	10,276,958
株式	1,877,725,971	1,729,614,724
未収配当金	7,895,002	1,024,916
流動資産合計	1,937,500,789	1,820,650,303
資産合計	1,937,500,789	1,820,650,303
負債の部		
流動負債		
未払解約金	418,000	3,040,000
流動負債合計	418,000	3,040,000
負債合計	418,000	3,040,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 595,971,478	579,085,916
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,341,111,311	1,238,524,387
元本等合計	1,937,082,789	1,817,610,303
純資産合計	1,937,082,789	1,817,610,303
負債純資産合計	1,937,500,789	1,820,650,303

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	623,761,541円	595,971,478円
期中追加設定元本額	8,697,562円	19,021,367円
期中一部解約元本額	36,487,625円	35,906,929円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,230,774円	8,635,772円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,049,367円	6,049,278円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	123,655,016円	124,058,555円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	17,792,167円	16,564,254円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	61,672,217円	58,398,913円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	125,676,386円	119,615,055円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	251,895,551円	245,764,089円
計	595,971,478円	579,085,916円
2. 期末日における受益権の総数	595,971,478口	579,085,916口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	75,719,914	85,902,933
合計	75,719,914	85,902,933

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	3,2503円	3,1388円
(1万口当たり純資産額)	(32,503円)	(31,388円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	11,804	25.645	302,713.580	
	UNILEVER PLC	5,507	45.370	249,852.590	
	AVIVA PLC	31,017	4.562	141,499.550	
	GSK	12,765	13.810	176,284.650	
	M&G PLC	69,004	1.942	134,005.760	
	ASTRAZENECA PLC	2,565	99.030	254,011.950	
	NATIONAL GRID PLC	22,742	9.758	221,916.430	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	252,008	0.530	133,765.840	
	HSBC HOLDINGS PLC	40,796	6.900	281,492.400	
イギリス・ポンド 小計				1,895,542.750 (374,843,579)	
スイス・フラン	NESTLE SA-REG	5,601	78.980	442,366.980	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	680	516.800	351,424.000	
	NOVARTIS AG-REG	4,406	92.860	409,141.160	
	GIVAUDAN-REG	78	3,904.000	304,512.000	
スイス・フラン 小計				1,507,444.140 (263,440,938)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	3,714	745.700	2,769,529.800	
デンマーク・クローネ 小計				2,769,529.800 (60,929,656)	
ユーロ	SIEMENS AG-REG	2,811	183.080	514,637.880	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,008	67.580	203,280.640	
	BASF SE	3,691	43.385	160,134.030	

ALLIANZ SE-REG	1,151	287.000	330,337.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	682	470.000	320,540.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	17,592	28.520	501,723.840	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,531	32.390	211,539.090	
KONINKLIJKE KPN NV	81,683	3.618	295,529.090	
TOTALENERGIES SE	5,130	56.840	291,589.200	
MICHELIN (CGDE)	8,652	31.390	271,586.280	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,229	240.750	536,631.750	
BNP PARIBAS	4,005	59.760	239,338.800	
DANONE	3,407	65.520	223,226.640	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	2,286	86.100	196,824.600	
CAPGEMINI SE	1,757	162.100	284,809.700	
PUBLICIS GROUPE	1,586	103.100	163,516.600	
AXA SA	8,612	33.860	291,602.320	
SANOFI	2,517	95.740	240,977.580	
INTESA SANPAOLO	81,160	3.835	311,289.180	
ENI SPA	12,981	13.930	180,825.330	
ENEL SPA	45,016	6.678	300,616.840	
ENAGAS SA	8,577	12.650	108,499.050	
KINGSPAN GROUP PLC	1,318	77.650	102,342.700	
ユーロ 小計			6,281,398.140 (1,030,400,551)	
合計			1,729,614,724 [1,729,614,724]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 9銘柄	100%	21.7%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	15.2%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	3.5%
ユーロ	株式 23銘柄	100%	59.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,938,608	5,660,363
コール・ローン	1,000,811	3,328,682
株式	734,221,025	743,740,063
派生商品評価勘定	1,689	-
未収配当金	3,102,381	868,990
流動資産合計	741,264,514	753,598,098
資産合計	741,264,514	753,598,098
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128	416
未払解約金	672,000	1,449,000
流動負債合計	672,128	1,449,416
負債合計	672,128	1,449,416
純資産の部		
元本等		
元本	1 182,322,906	170,679,778
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	558,269,480	581,468,904
元本等合計	740,592,386	752,148,682
純資産合計	740,592,386	752,148,682
負債純資産合計	741,264,514	753,598,098

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	204,002,975円	182,322,906円
期中追加設定元本額	6,706,436円	12,566,876円
期中一部解約元本額	28,386,505円	24,210,004円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,496,479円	6,374,053円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,783,557円	4,381,100円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	97,846,519円	92,557,914円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	14,323,544円	12,514,145円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）	8,092,981円	7,602,871円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）	16,777,401円	15,538,583円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	33,002,425円	31,711,112円
計	182,322,906円	170,679,778円
2. 期末日における受益権の総数	182,322,906口	170,679,778口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	2,991,676	9,648,686
合計	2,991,676	9,648,686

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年5月10日現在				2024年11月11日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	3,100,000	-	3,098,439	1,561	800,000	-	800,416	416
アメリカ・ドル	3,100,000	-	3,098,439	1,561	800,000	-	800,416	416
合計	3,100,000	-	3,098,439	1,561	800,000	-	800,416	416

(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5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0620円 (40,620円)	4.4068円 (44,068円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	6,720	32.130	215,913.600	
	BHP GROUP LTD	6,200	43.400	269,080.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4,478	24.070	107,785.460	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,200	19.550	62,560.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	5,300	39.650	210,145.000	
	WESTPAC BANKING CORP	6,500	32.140	208,910.000	
	RIO TINTO LTD	690	123.310	85,083.900	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,800	9.910	67,388.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,630	149.320	392,711.600	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	6,400	18.250	116,800.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	760	228.530	173,682.800	
	CSL LTD	595	285.290	169,747.550	
	WESFARMERS LTD	2,230	68.420	152,576.600	
オーストラリア・ドル 小計				2,232,384.510 (225,247,596)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	37,700	2.790	105,183.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,400	42.400	186,560.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,200	16.060	163,812.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	51,600	3.250	167,700.000	
シンガポール・ドル 小計				623,255.000 (71,911,162)	
韓国・ウォン	KIA CORP	790	93,000.000	73,470,000.000	
	SK HYNIX INC	1,130	200,500.000	226,565,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	605	203,500.000	123,117,500.000	
	KT&G CORP	1,120	119,500.000	133,840,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,250	93,200.000	116,500,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,205	57,000.000	410,685,000.000	

韓国・ウォン 小計				1,084,177,500.000 (118,934,272)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	5,000	66.300	331,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	23,000	26.050	599,150.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,000	339.400	339,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	15,000	16.460	246,900.000	
	AIA GROUP LTD	19,000	61.950	1,177,050.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	5,500	109.600	602,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	24,500	26.050	638,225.000	
香港・ドル 小計				3,935,025.000 (77,519,993)	
台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	63,000	47.550	2,995,650.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	18,000	155.500	2,799,000.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	10,000	400.000	4,000,000.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	500.000	1,500,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	9,000	328.000	2,952,000.000	
	MEDIATEK INC	4,000	1,280.000	5,120,000.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	36,600	92.900	3,400,140.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3,000	488.500	1,465,500.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	9,000	174.000	1,566,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	14,300	1,090.000	15,587,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	29,000	218.000	6,322,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	4,000	621.000	2,484,000.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	49,000	46.650	2,285,850.000	
台湾・ドル 小計				52,477,140.000 (250,127,040)	
合計				743,740,063 [743,740,063]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	----------------

オーストラリア・ドル	株式	13銘柄	100%	30.3%
シンガポール・ドル	株式	4銘柄	100%	9.7%
韓国・ウォン	株式	6銘柄	100%	16.0%
香港・ドル	株式	7銘柄	100%	10.4%
台湾・ドル	株式	13銘柄	100%	33.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年5月10日現在 金額（円）	2024年11月11日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,369,329,892	2,193,137,125
投資証券	2 154,863,301,750	164,414,394,996
派生商品評価勘定	153,529,510	-
未収入金	385,803,077	579,112,167
未収配当金	1,963,875,905	2,003,317,359
前払金	-	86,646,000
流動資産合計	158,735,840,134	169,276,607,647
資産合計	158,735,840,134	169,276,607,647
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	83,300,000
前受金	174,819,500	-
未払金	640,459,621	813,263,531
未払解約金	9,352,000	3,014,000
流動負債合計	824,631,121	899,577,531
負債合計	824,631,121	899,577,531
純資産の部		
元本等		

元本	1	44,907,533,552	50,047,420,685
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		113,003,675,461	118,329,609,431
元本等合計		157,911,209,013	168,377,030,116
純資産合計		157,911,209,013	168,377,030,116
負債純資産合計		158,735,840,134	169,276,607,647

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11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5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1期首	2023年11月11日	2024年5月11日
期首元本額	47,919,612,913円	44,907,533,552円
期中追加設定元本額	3,591,414,258円	5,295,920,512円
期中一部解約元本額	6,603,493,619円	156,033,379円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	41,531,984,435円	46,576,954,603円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	12,702,629円	12,418,257円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,362,936円	8,662,657円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	47,555,586円	50,275,210円
6資産バランスファンド(分配型)	76,488,075円	74,837,790円
6資産バランスファンド(成長型)	251,837,997円	241,124,755円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	20,266,803円	-円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	24,018,164円	23,465,939円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	448,256,473円	480,512,687円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	598,381,314円	649,884,380円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	969,584,981円	1,058,936,209円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	212,547,037円	203,458,876円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)	59,838,704円	56,733,835円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)	18,749,062円	17,573,759円
ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	100,097,769円	93,272,606円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	526,861,587円	499,309,122円
計	44,907,533,552円	50,047,420,685円
2. 期末日における受益権の総数	44,907,533,552口	50,047,420,685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 1,125,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 564,000,000円
--------------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月11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あります。

(2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	601,415,411	10,284,128,888
合計	601,415,411	10,284,128,888

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2024年5月10日現在				2024年11月11日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	2,384,629,000	-	2,538,313,500	153,684,500	2,423,946,000	-	2,340,800,000	83,146,000
合計	2,384,629,000	-	2,538,313,500	153,684,500	2,423,946,000	-	2,340,800,000	83,146,000

(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5月10日現在	2024年11月11日現在
1口当たり純資産額	3,5164円	3,3643円
（1万口当たり純資産額）	（35,164円）	（33,643円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	2,305	261,387,000	
	サンケイリアルエステート	4,880	384,056,000	
	SOSILA物流リート投	8,961	973,164,600	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	7,815	4,618,665,000	
	森ヒルズリート	19,411	2,474,902,500	
	産業ファンド	40,964	4,690,378,000	
	アドバンス・レジデンス	11,343	3,442,600,500	
	A P I 投資法人	14,317	4,645,866,500	
	G L P 投資法人	62,576	8,084,819,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,108	3,223,541,600	
	日本プロロジスリート	42,724	10,497,286,800	
	星野リゾート・リート	7,076	1,606,959,600	
	O n e リート投資法人	1,760	400,400,000	
	イオンリート投資	8,329	1,054,451,400	
	ヒューリックリート投資法	23,495	3,096,641,000	
	日本リート投資法人	9,082	2,878,994,000	
	積水ハウス・リート投資	18,644	1,370,334,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,468	306,525,600	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,369	144,840,200	
	野村不動産マスターF	53,541	7,554,635,100	
ラサールロジポート投資	20,689	2,983,353,800		
スターアジア不動産投	30,694	1,543,908,200		

三井不口ジパーク	21,125.672	2,099,891,796	
投資法人みらい	4,601	181,279,400	
三菱地所物流REIT	6,947	2,462,711,500	
CREロジスティクスファンド	16,476	2,290,164,000	
ザイマックス・リート	1,141	124,369,000	
タカラレーベン不動産投	3,293	277,929,200	
日本ビルファンド	87,040	11,306,496,000	
ジャパンリアルエステイト	11,236	6,337,104,000	
日本都市ファンド投資法人	109,834	10,137,678,200	
オリックス不動産投資	41,607	6,669,602,100	
日本プライムリアルティ	12,633	4,257,321,000	
NTT都市開発リート投資法人	22,790	2,486,389,000	
東急リアル・エステート	7,298	1,131,919,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	33,579	4,664,123,100	
森トラストリート投資法人	21,772	1,336,800,800	
インヴィンシブル投資法人	102,224	6,470,779,200	
フロンティア不動産投資	6,555	2,654,775,000	
平和不動産リート	7,488	902,304,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,878	2,435,235,400	
福岡リート投資法人	1,081	153,610,100	
KDX不動産投資法人	54,585	8,007,619,500	
いちごオフィスリート投資法人	9,659	759,197,400	
大和証券オフィス投資法人	6,510	1,992,060,000	
阪急阪神リート投資法人	8,410	1,012,564,000	
スタートプロシード投資法人	4,991	857,453,800	
大和ハウスリート投資法人	35,841	8,318,696,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	85,935	5,886,547,500	
大和証券リビング投資法人	23,141	2,117,401,500	
ジャパンエクセレント投資法人	7,140	844,662,000	
投資証券 合計		164,414,394,996	
合計		164,414,394,996	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

ジャパンリアルエステイト 1,000口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2024年5月11日から2024年11月11日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,892,602	15,200,355
親投資信託受益証券	598,372,889	589,697,096
流動資産合計	619,265,491	604,897,451
資産合計	619,265,491	604,897,451
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,553,469	5,902,317
未払解約金	303	306,603
未払受託者報酬	55,115	55,785
未払委託者報酬	1,350,794	1,367,180
その他未払費用	25,168	25,067
流動負債合計	12,984,849	7,656,952
負債合計	12,984,849	7,656,952
純資産の部		
元本等		
元本	1,577,673,492	1,590,231,748
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,607,150	7,008,751
（分配準備積立金）	49,601,133	52,068,476
元本等合計	606,280,642	597,240,499
純資産合計	606,280,642	597,240,499
負債純資産合計	619,265,491	604,897,451

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	2023年11月11日 至 2024年5月10日	自	2024年5月11日 至 2024年11月11日
営業収益				
受取利息		718		5,913
有価証券売買等損益		64,677,722		12,324,207
営業収益合計		64,678,440		12,330,120
営業費用				
支払利息		217		-
受託者報酬		168,330		167,710
委託者報酬		1 4,125,213		1 4,109,921
その他費用		25,168		25,067
営業費用合計		4,318,928		4,302,698
営業利益又は営業損失（ ）		60,359,512		8,027,422
経常利益又は経常損失（ ）		60,359,512		8,027,422
当期純利益又は当期純損失（ ）		60,359,512		8,027,422
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,079,042		109,779
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,893,600		28,607,150
剰余金増加額又は欠損金減少額		406,501		915,340
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		406,501		915,340
剰余金減少額又は欠損金増加額		830,752		576,265
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		830,752		576,265
分配金		2 32,142,669		2 29,855,117
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,607,150		7,008,751

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期
	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2024年11月10日が休日のため、当特定期間末日を2024年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首元本額	625,034,594円	577,673,492円
期中追加設定元本額	13,902,923円	26,009,965円
期中一部解約元本額	61,264,025円	13,451,709円
2. 特定期間末日における受益権の総数	577,673,492口	590,231,748口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	自2023年11月11日 至2024年5月10日	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	173,642円	173,530円

2. 2 分配金の計算過程

<p>(自2023年11月11日至2024年1月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,163,326円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(15,787,215円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,065,507円)及び分配準備積立金(24,891,965円)より分配対象額は48,908,013円(1万口当たり816.41円)であり、うち5,990,626円(1万口当たり100円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年5月11日至2024年7月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,502,077円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(27,517,694円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,877,629円)及び分配準備積立金(48,909,773円)より分配対象額は85,807,173円(1万口当たり1,488.03円)であり、うち23,066,036円(1万口当たり400円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2024年1月11日至2024年3月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,222,593円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(14,696,433円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,028,510円)及び分配準備積立金(35,807,111円)より分配対象額は58,754,647円(1万口当たり1,006.17円)であり、うち14,598,574円(1万口当たり250円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年7月11日至2024年9月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(900,534円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,780,349円)及び分配準備積立金(55,554,583円)より分配対象額は65,235,466円(1万口当たり1,103.49円)であり、うち886,764円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2024年3月12日至2024年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,914,846円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(20,826,813円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,279,443円)及び分配準備積立金(37,412,943円)より分配対象額は67,434,045円(1万口当たり1,167.34円)であり、うち11,553,469円(1万口当たり200円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年9月11日至2024年11月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,603,105円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,879,364円)及び分配準備積立金(55,367,688円)より分配対象額は66,850,157円(1万口当たり1,132.61円)であり、うち5,902,317円(1万口当たり100円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	当期 自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期
	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	24,566,542	20,116,555
合計	24,566,542	20,116,555

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期	当期
2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期
自2024年5月11日
至2024年11月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0495円 (10,495円)	1.0119円 (10,119円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	191,203,498	413,840,851	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	6,029,236	28,807,086	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	9,973,367	60,226,171	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	2,641,023	19,385,108	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	6,049,278	18,987,473	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	4,381,100	19,306,631	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	8,662,657	29,143,776	
親投資信託受益証券 合計			589,697,096	
合計			589,697,096	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

【成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2024年5月11日から2024年11月11日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	200,173,186	109,636,800
親投資信託受益証券	3,380,593,553	3,465,820,612
流動資産合計	3,580,766,739	3,575,457,412
資産合計	3,580,766,739	3,575,457,412
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	157,819,496	67,884,623
未払解約金	2,180,304	2,710,583
未払受託者報酬	312,612	323,216
未払委託者報酬	8,128,456	8,404,174
その他未払費用	138,671	144,591
流動負債合計	168,579,539	79,467,187
負債合計	168,579,539	79,467,187
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,156,389,929	1 3,394,231,187
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	255,797,271	101,759,038
（分配準備積立金）	320,006,941	262,520,401
元本等合計	3,412,187,200	3,495,990,225
純資産合計	3,412,187,200	3,495,990,225
負債純資産合計	3,580,766,739	3,575,457,412

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	2023年11月11日	自	2024年5月11日
	至	2024年5月10日	至	2024年11月11日
営業収益				
受取利息		3,998		32,877
有価証券売買等損益		565,835,249		134,227,059
営業収益合計		565,839,247		134,259,936
営業費用				
支払利息		1,452		-
受託者報酬		925,062		964,524
委託者報酬	1	24,052,805	1	25,078,861
その他費用		138,671		144,591
営業費用合計		25,117,990		26,187,976
営業利益又は営業損失（ ）		540,721,257		108,071,960
経常利益又は経常損失（ ）		540,721,257		108,071,960
当期純利益又は当期純損失（ ）		540,721,257		108,071,960
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		3,794,439		433,160
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		144,071,882		255,797,271
剰余金増加額又は欠損金減少額		19,232,327		21,210,429
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		19,232,327		21,210,429
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,855,504		7,050,877
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,855,504		7,050,877
分配金	2	436,578,252	2	275,836,585
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		255,797,271		101,759,038

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期
	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2024年11月10日が休日のため、当特定期間末日を2024年11月11日としております。このため、当特定期間は185日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
1. 1 期首元本額	3,074,310,559円	3,156,389,929円
期中追加設定元本額	223,801,785円	364,517,711円
期中一部解約元本額	141,722,415円	126,676,453円
2. 特定期間末日における受益権の総数	3,156,389,929口	3,394,231,187口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期	当期
	自2023年11月11日 至2024年5月10日	自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	2,346,522円	2,452,636円

2. 2 分配金の計算過程

<p>(自2023年11月11日至2024年1月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(10,151,340円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(111,117,806円)、投資信託約款に規定される収益調整金(63,851,092円)及び分配準備積立金(226,103,739円)より分配対象額は411,223,977円(1万口当たり1,337.91円)であり、うち92,208,939円(1万口当たり300円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年5月11日至2024年7月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(15,605,279円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(188,850,800円)、投資信託約款に規定される収益調整金(95,701,996円)及び分配準備積立金(315,076,666円)より分配対象額は615,234,741円(1万口当たり1,897.97円)であり、うち194,492,682円(1万口当たり600円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2024年1月11日至2024年3月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(11,773,991円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(211,158,641円)、投資信託約款に規定される収益調整金(70,707,965円)及び分配準備積立金(252,075,641円)より分配対象額は545,716,238円(1万口当たり1,755.19円)であり、うち186,549,817円(1万口当たり600円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年7月11日至2024年9月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,017,945円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(115,792,095円)及び分配準備積立金(321,101,657円)より分配対象額は439,911,697円(1万口当たり1,307.39円)であり、うち13,459,280円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2024年3月12日至2024年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(27,788,573円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(164,936,467円)、投資信託約款に規定される収益調整金(79,774,213円)及び分配準備積立金(285,101,397円)より分配対象額は557,600,650円(1万口当たり1,766.58円)であり、うち157,819,496円(1万口当たり500円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2024年9月11日至2024年11月11日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(23,114,860円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(122,997,963円)及び分配準備積立金(307,290,164円)より分配対象額は453,402,987円(1万口当たり1,335.80円)であり、うち67,884,623円(1万口当たり200円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	当期 自2024年5月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期
	2024年11月11日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	194,390,742	206,128,386
合計	194,390,742	206,128,386

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期	当期
2024年5月10日現在	2024年11月11日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期
自2024年5月11日
至2024年11月11日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2024年5月10日現在	当期 2024年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0810円 (10,810円)	1.0300円 (10,300円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	315,708,673	683,319,851	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	35,558,002	169,892,577	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	204,197,303	1,233,086,253	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	56,280,904	413,101,835	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	124,058,555	389,394,992	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	92,557,914	407,884,215	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	50,275,210	169,140,889	
親投資信託受益証券 合計			3,465,820,612	
合計			3,465,820,612	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

2024年11月29日

資産総額	889,352,242円
負債総額	1,435,287円
純資産総額（ - ）	887,916,955円
発行済数量	889,760,377口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9979円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	15,549,112,516円
負債総額	7,580,115円
純資産総額（ - ）	15,541,532,401円
発行済数量	7,268,974,459口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1381円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	75,395,570,330円
負債総額	93,703,430円
純資産総額（ - ）	75,301,866,900円
発行済数量	62,121,995,639口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2122円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	102,388,372,850円
負債総額	312,479,466円
純資産総額(-)	102,075,893,384円
発行済数量	21,269,703,781口
1単位当たり純資産額(/)	4.7991円

(参考) ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	171,246,820,155円
負債総額	1,289,591,643円
純資産総額(-)	169,957,228,512円
発行済数量	50,759,234,714口
1単位当たり純資産額(/)	3.3483円

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	7,465,547,748円
負債総額	644,969円
純資産総額(-)	7,464,902,779円
発行済数量	1,036,601,602口
1単位当たり純資産額(/)	7.2013円

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	1,935,477,219円
負債総額	0円
純資産総額(-)	1,935,477,219円

発行済数量	632,347,487口
1単位当たり純資産額(/)	3.0608円

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	737,723,872円
負債総額	144,577円
純資産総額(-)	737,579,295円
発行済数量	176,908,612口
1単位当たり純資産額(/)	4.1693円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	45,019,403,368円
負債総額	136,403,836円
純資産総額(-)	44,882,999,532円
発行済数量	7,554,163,594口
1単位当たり純資産額(/)	5.9415円

インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額	589,399,649円
負債総額	3,167,243円
純資産総額(-)	586,232,406円
発行済数量	587,528,658口
1単位当たり純資産額(/)	0.9978円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

2024年11月29日

資産総額

3,452,907,120円

負債総額	3,522,562円
純資産総額（ - ）	3,449,384,558円
発行済数量	3,417,529,270口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0093円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2024年11月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

過去5年間における資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

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11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	90	348,957
追加型株式投資信託	793	29,960,833
株式投資信託 合計	883	30,309,790
単位型公社債投資信託	77	152,655
追加型公社債投資信託	14	1,393,841
公社債投資信託 合計	91	1,546,496
総合計	974	31,856,286

3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「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282条及び第306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、第65期事業年度（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。

また、第66期事業年度に係る中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

(単位:百万円)

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

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048

福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品

4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

3 保証債務

前事業年度（2023年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,112百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年 3月31日	2022年 6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,316百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,955円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月27日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2024年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	-	7,939
資産合計	57	7,882	-	7,939

当事業年度（2024年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	-	8,285
資産合計	144	8,141	-	8,285

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式	666	666
子会社株式	1,448	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,448百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,448百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	57	55	1
(2) その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	392
小計	2,798	3,190	392
合計	7,939	7,168	771

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	144	55	89
（2）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	213
小計	1,543	1,756	213
合計	8,285	6,079	2,205

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	-	-	-
（2）その他			
証券投資信託	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	-	-	-
（2）その他			
証券投資信託	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について257百万円、関係会社株式について229百万円の減損処理を行っております。

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

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	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(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	当事業年度
	(2023年3月31日)	(2024年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2023年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2024年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社はグループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が76,221百万円、その他717百万円であります。

（2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（3）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				

親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	17,100 0	関係会社短期貸付金 -	22,100 -
-----	---------------	---------	---------	---------	--------------	----	------	-----------------------	-------------	----------------	-------------

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	2,112	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	2,354	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
							不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注3)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,983.42円	1株当たり純資産額	15,956.63円
1株当たり当期純利益	3,955.35円	1株当たり当期純利益	4,546.57円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(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%

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2024年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
固定資産		
有形固定資産	1	60
無形固定資産		
ソフトウェア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
投資その他の資産		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748

その他	1,095
投資その他の資産合計	14,924
固定資産合計	16,211
資産合計	58,128

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2024年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金	6,580
未払費用	5,540
未払法人税等	4,405
賞与引当金	910
その他	2 1,107

流動負債合計	18,545
--------	--------

固定負債

退職給付引当金	2,270
役員退職慰労引当金	55

固定負債合計	2,325
--------	-------

負債合計

負債合計	20,870
------	--------

純資産の部

株主資本

資本金	15,174
-----	--------

資本剰余金

資本準備金	11,495
-------	--------

資本剰余金合計	11,495
---------	--------

利益剰余金

利益準備金	374
-------	-----

その他利益剰余金

繰越利益剰余金	8,774
---------	-------

利益剰余金合計	9,148
---------	-------

株主資本合計

株主資本合計	35,818
--------	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,438
--------------	-------

評価・換算差額等合計	1,438
------------	-------

純資産合計

純資産合計	37,257
-------	--------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	58,128
----------	--------

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	44,508
その他営業収益	483
営業収益合計	44,992
営業費用	
支払手数料	18,092
その他営業費用	9,300
営業費用合計	27,392
一般管理費	1 6,708
営業利益	10,890
営業外収益	2 281
営業外費用	3 21
経常利益	11,150
特別利益	4 491
特別損失	5 154
税引前中間純利益	11,487
法人税、住民税及び事業税	4,086
法人税等調整額	183
中間純利益	7,584

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30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	

当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,858	11,858	11,858
中間純利益	-	-	-	7,584	7,584	7,584
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額 合計	-	-	-	4,274	4,274	4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,858
中間純利益	-	-	7,584
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	91	91	91
当中間期変動額 合計	91	91	4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

５．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

（中間貸借対照表関係）

１ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2024年9月30日現在)
有形固定資産	358百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2024年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	184百万円
有価証券償還益	45百万円
受取配当金	27百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
為替差損	17百万円

4 特別利益の項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	380百万円
固定資産売却益	
美術品	83百万円
ゴルフ会員権	26百万円

5 特別損失の項目

当中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2024年6月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 3月31日	2024年 6月20日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2024年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	1,602	8,991	-	10,594
資産合計	1,602	8,991	-	10,594

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、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

市場で取得した株式及び上場投資信託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のうちレベル1の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

(注 2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間（2024年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,386百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	123	55	67

(2) その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,756	3,988	232
小計	3,756	3,988	232
合計	10,594	8,520	2,073

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 342百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が44,508百万円、その他483百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

(3) 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	14,283.03円
1株当たり中間純利益	2,907.52円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

(株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会及び2024年6月27日開催の臨時株主総会において、株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行について決議し、2024年10月1日付で払込手続きが完了いたしました。

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
払込日	2024年10月1日
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%

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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し、本提携に基づき2024年10月1日、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した。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (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	アイザワ証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	株式会社SBI証券	54,323百万円	(注1)	
	寿証券株式会社	305百万円	(注1)	
	内藤証券株式会社	3,002百万円	(注1)	
	南都まほろば証券株式 会社	3,000百万円	(注1)	
	ニュース証券株式会社	1,000百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	松井証券株式会社	11,945百万円	(注1)	
	松阪証券株式会社	100百万円	(注1)	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	楽天証券株式会社	19,495百万円	(注1)	
	株式会社きらやか銀行	34,100百万円	(注3)	
	岐阜信用金庫	20,320百万円	(注7)	(*1)
	株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	(注3)	
	ザ・ホンコン・アン ド・シャンハイ・バン キング・コーポレイ ション・リミテッド	百万円	(注3)	(*2)
	湘南信用金庫	25,186百万円	(注7)	(*1)
	株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	(注3)	
	全国信用協同組合連合 会	118,875百万円	(注5)	(*1)
	株式会社但馬銀行	5,481百万円	(注3)	
	株式会社東北銀行	13,233百万円	(注3)	
	株式会社東和銀行	38,653百万円	(注3)	
	株式会社栃木銀行	27,408百万円	(注3)	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	(注3)		
株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	(注3)		
株式会社福島銀行	18,682百万円	(注3)		

投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912千円	(注13)	
	コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	564千米ドル	(注13)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

(*1) 出資金を記載しています。

(*2) 1,239億4,847万9,495香港ドル、71億9,800万米ドル(香港ドル建と米ドル建の株式が発行されており、合算せずに併記しております。)

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部(信託財産の管理等)を行ないます。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド、ダイワ北米好配当株マザーファンドおよびダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます。

3【資本関係】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しています。

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,600株所有しています。

第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2024年5月24日	臨時報告書
2024年7月25日	臨時報告書
2024年8月2日	有価証券報告書、有価証券届出書
2024年9月26日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2024年5月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表

を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年12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 秋山 範之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年5月11日から2024年11月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年12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 秋山 範之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年5月11日から2024年11月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年12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 秋山 範之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年5月11日から2024年11月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2024年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月25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	渡部 啓太
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松田 好弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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10月1日付で株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行を実施している。

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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。