

ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド

(愛称：賢者のセオリー)

追加型投信／内外／資産複合
※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2023年2月4日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド(愛称:賢者のセオリー)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2023年2月3日に関東財務局長に提出しており、2023年2月4日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド（愛称：賢者のセオリー）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1 兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1 万口当たり取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2023 年 2 月 4 日から 2023 年 8 月 3 日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類表

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
	海外	債券
追加型投信	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

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	年6回（隔月）	アジア		
その他債券		オセアニア		
クレジット属性（ ）				
不動産投信	年12回（毎月）	中南米		
その他資産		アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
（投資信託証券）	日々	中近東（中東）		
（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、商品先物））		エマージング		
資産複合（ ）	その他（ ）			
資産配分固定型				
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。

（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
	MR F（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MR F
	E T F	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
決算頻度	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
	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
投資対象地域	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの
	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第 2 条に規定するファンド・オブ・ファンズ

為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経 225	目論見書等において、日経 225 に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIX に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

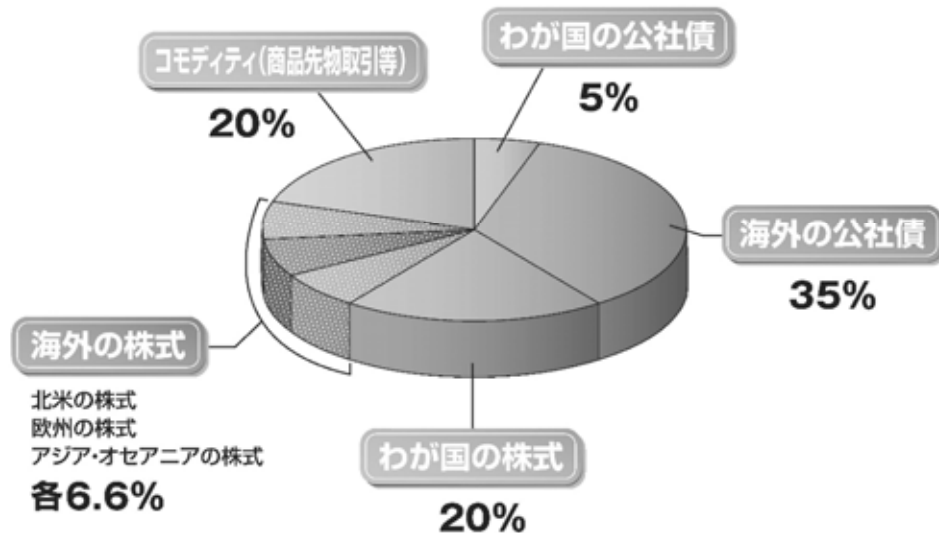
<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000 億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

1

内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資します。

●各資産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。



※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。

●当ファンドは、以下の7本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

■ 投資対象ファンド

- ①ダイワ日本国債マザーファンド
- ②ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
- ③ダイワ好配当日本株マザーファンド
- ④ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ⑤ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ⑥ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ⑦ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa "RICI" Fund」（以下「ダイワ "RICI" ファンド」といいます。）（米ドル建て）

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の7本の投資信託証券への投資を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資します。

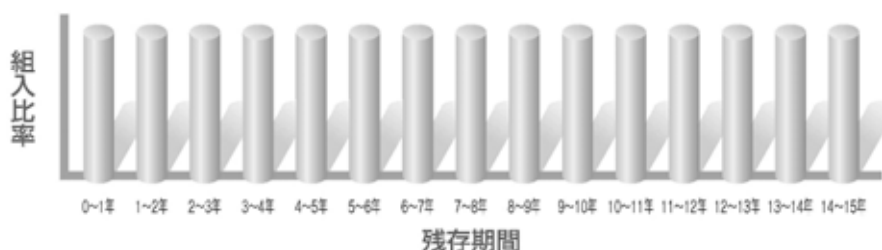


※くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

2 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、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。

3

海外の公社債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

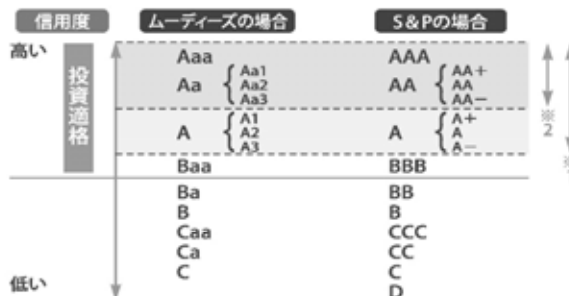
※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

※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



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

※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

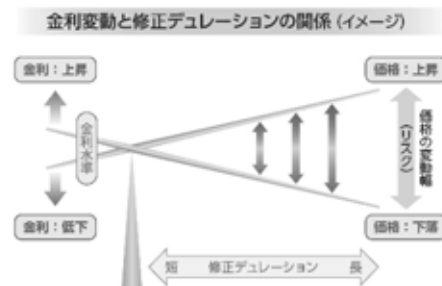
※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

修正デュレーションについて

- 修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。

- 修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動（ブレ幅）が大きくなります。



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

4

わが国の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。

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

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

5

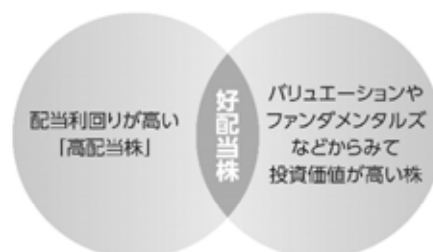
海外の株式への投資にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。

- 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・インクについて〉

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

- ◆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 コモディティ（商品先物取引等）への投資にあたっては、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動することをめざします。

- ダイワ“RICI”ファンドの信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。

コモディティとは…

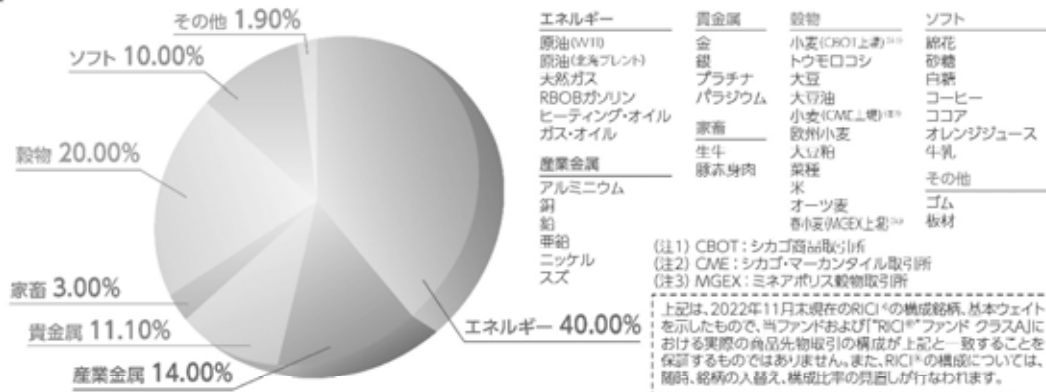
コモディティとは身近にあるさまざまな製品の原材料になるもので、主要な品目としては、原油や天然ガスなどの「エネルギー」、金・銀や銅・アルミニウムなどの「金属」、そして小麦・トウモロコシや生牛・豚赤身肉などの「農畜産物」などがあり、一般的に商品先物取引所に上場されています。

コモディティのイメージ



(注)上記のコモディティはあくまでも一例であり、他にもヒーティング・オイル、プラチナ、ニッケル、大豆、砂糖などがあります。

RICI構成比率および構成銘柄



「RICI（ロジャーズ国際コモディティ指数）について…」

- ・RICIは、世界中の経済活動に広く利用されているコモディティ（商品）の値動きを表します。
- ・RICIは、1998年8月より計算および公表を行なっております。
- ・RICIを構成する品目とその比率は、ジム・ロジャーズが議長をつとめるRICI委員会において、各品目の需要見通しおよび先物市場の流動性等を勘案して決定されます。
- ・RICIは、投資可能性を考慮に入れた実用性の高い指数です。

「RICI構成比率および構成銘柄」の変更については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

【注記】

「ダイワ・株・債券・コモディティ・バランスファンド（愛称：賢者のセオリー）」およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。）はJames Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc.（以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。）により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Indexの決定、構成、算出において大和アセットマネジメント株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers」、「Rogers International Commodity Index」および「RICI」は、James Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc.のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

・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。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まる場合があります。

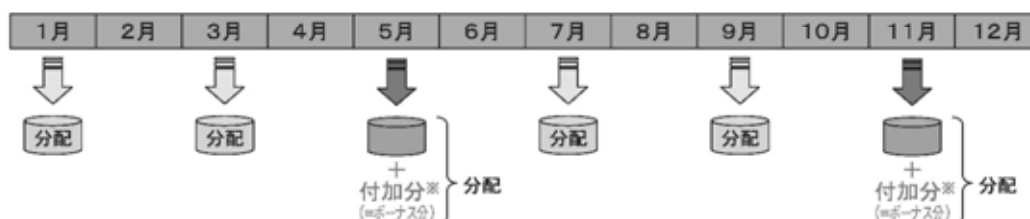
7

毎年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〉

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
 - ② 原則として、配当等収益等を中心に継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1万口当たり。以下同じ。）が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合…500円を上限とします。
 - ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合…1,000円を上限とします。

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。

投資対象ファンドの概要

I. ダイワ日本国債マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	わが国の国債を投資対象とし、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。
投 資 態 度	①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。 ②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。 ③国債の組入れは原則として高位を保ちます。 ④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。
信 託 期 間	無期限（2005年3月29日当初設定）
決 算 日	毎年3月10日（休業日の場合翌営業日）
運 用 管 理 費 用 （ 信 託 報 酬 ）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

Ⅱ. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	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。
投 資 態 度	①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。 ②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。 イ. 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 ロ. 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。) ハ. 国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。 ニ. 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。 ホ. 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。 ③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。
信 託 期 間	無期限(2005年4月26日当初設定)
決 算 日	毎年4月10日および10月10日(休業日の場合翌営業日)
運 用 管 理 費 用 (信 託 報 酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

Ⅲ. ダイワ好配当日本株マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
投 資 態 度	①主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)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。 ②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。 ③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。 ④J-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。
信 託 期 間	無期限(2005年7月11日当初設定)
決 算 日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運 用 管 理 費 用 (信 託 報 酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

Ⅳ. ダイワ北米好配当株マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	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、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て運用を行ないます。
投 資 態 度	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。
信 託 期 間	無期限(2005年10月28日当初設定)
決 算 日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運 用 管 理 費 用 (信 託 報 酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

V. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	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、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て運用を行ないます。
投 資 態 度	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。
信 託 期 間	無期限(2005年10月28日当初設定)
決 算 日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運 用 管 理 費 用 (信 託 報 酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

VI. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

形 態	証券投資信託／親投資信託
基 本 方 針	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、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て運用を行ないます。
投 資 態 度	①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。 ②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。 ③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。 ④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。
信 託 期 間	無期限(2005年10月28日当初設定)
決 算 日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用 (信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	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。)および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委 託 会 社	大和アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

[各マザーファンド共通]

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。

Ⅶ. ダイワ“RICI”ファンド

形態／表示通貨	ケイマン籍の外国証券投資信託／米ドル建て
運用目的	当ファンドは、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数(“RICI”)に連動することをめざします。
投資方針	①信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数(“RICI”)に連動する投資成果をめざします。 ②米ドル建て短期公社債等への投資にあたっては、主に1年以内に償還を迎える米ドル建て短期公社債等に投資します。また、投資対象には、銀行引受手形、預託証書、コマーシャル・ペーパー、定期預金証書などへの投資も含まれますが、これに限定いたしません。 ③信託財産の純資産総額の50%未満の部分で商品先物取引および商品先渡取引に投資します。 ④当ファンドの純資産に占める、商品先物取引および商品先渡取引等の証拠金の割合はおおよそ10-30パーセントの範囲で行ないます。(また、最大でも、純資産の50%以下とします。) ⑤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、上記のような運用が行なわれない場合があります。 ⑥当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。
関係法人	管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービス・リミテッド(ケイマン) 受託会社：G.A.S.(ケイマン)リミテッド 運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド 資産保管会社：SMT Trustees (Ireland) Limited 管理事務代行会社：SMT Fund Services (Ireland) Limited 管理会社代行サービス会社：大和アセットマネジメント株式会社
報酬等	信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額 管理報酬等：0.415% (管理会社代行サービス報酬を含みます。) 受託報酬等：0.175% (管理事務代行報酬および資産保管会社の報酬を含みます。) 運用報酬等：0.41% 合計：1.00% その他、外国投資信託に関する租税、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。
設定日	2006年11月13日
決算日	毎年4月30日

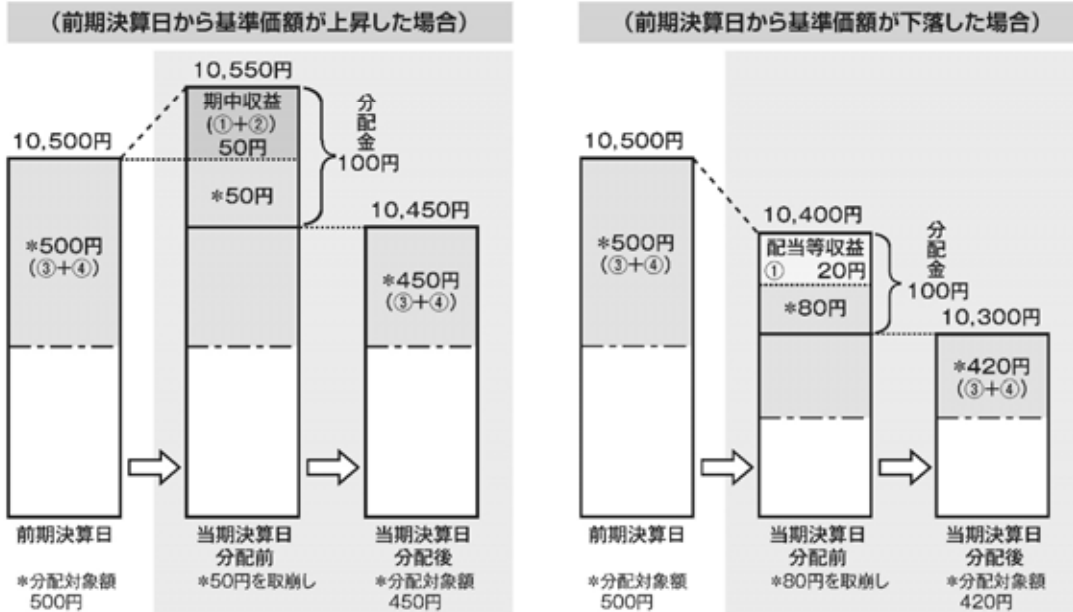
[収益分配金に関する留意事項]

- 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。



- 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)



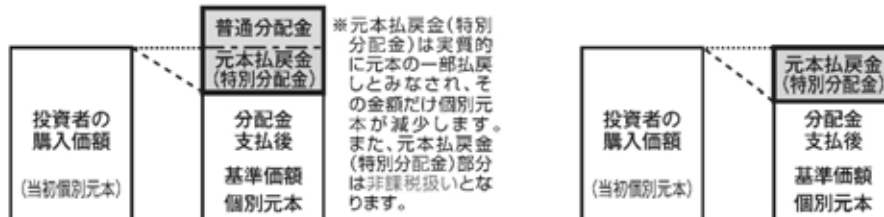
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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率が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)



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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006 年 11 月 10 日

信託契約締結、当初設定、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	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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
↑↓※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	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※5）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	投資対象ファンドの受益証券 など （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における外貨建資産の運用にあたっては、それぞれコーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク、アムンディ・アイルランド・リミテッド（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。）	

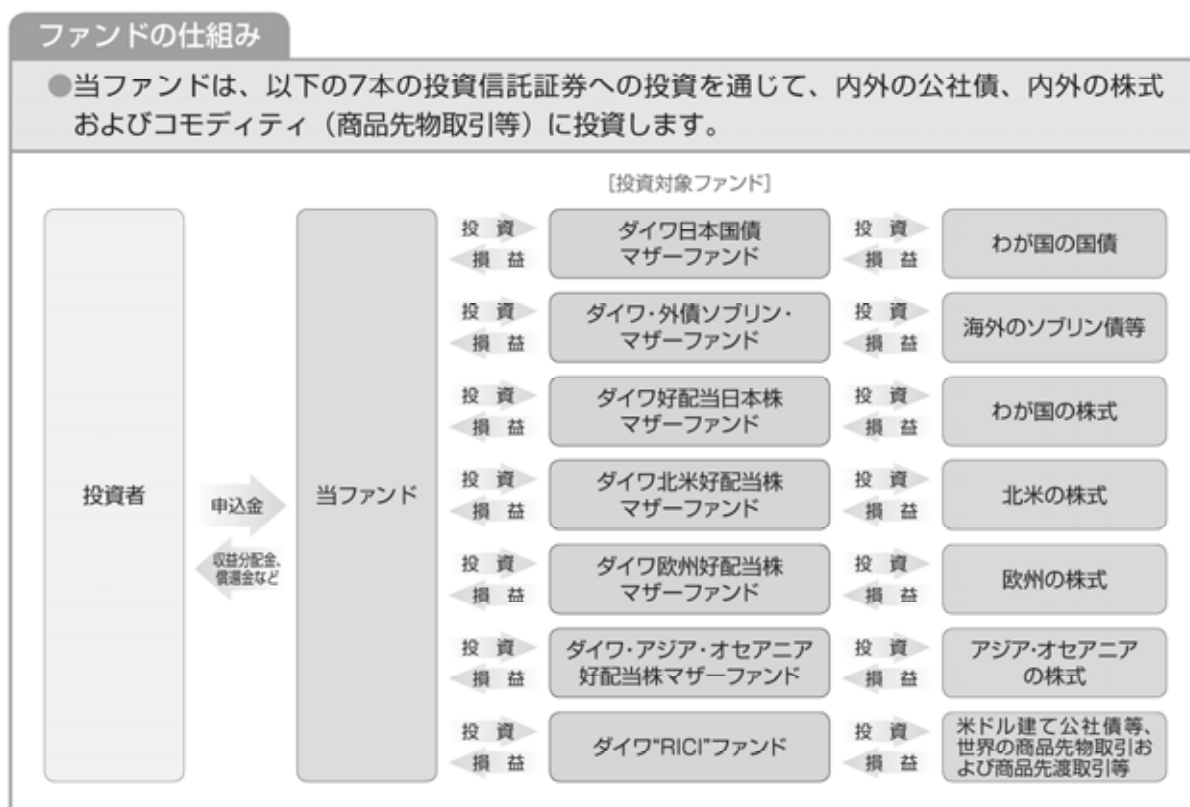
（注 1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

（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す（※4）。

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

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

- ※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- ※4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- ※5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。
- ◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。



< 委託会社の概況（2022年11月末日現在） >

- ・資本金の額 151 億 7,427 万 2,500 円
- ・沿革
 - 1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立
 - 1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 1960年 4月 1日 営業開始
 - 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
 - 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第 29 条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第 352 号)
 - 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
- ・大株主の状況

名 称	住 所	所有	比率
-----	-----	----	----

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

① 主要投資対象

下記の各ファンド（1. から 6. ままでに掲げるファンドを、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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
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
7. ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下「ダイワ “RICI” ファンド」といいます。）の受益証券（米ドル建）

② 投資態度

イ. 主として複数の投資信託証券を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

ロ. 各投資信託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。

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ・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 20%

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 6.6%

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 6.6%

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 6.6%

ダイワ “RICI” ファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の 20%

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

ニ. 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。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まることがあります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	ダイワ “RICI” ファンド
選 定 の 方 針	信託財産の純資産総額の 50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動する投資成果をめざすファンドであること。

くわしくは「1 ファンドの性格(1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」をご参照下さい。

(2)【投資対象】

- ① 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
- ② 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次の1. から6. までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の7. に掲げる外国投資信託の受益証券、ならびに次の8. から11. までに掲げる有価証券（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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
 2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
 3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
 4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
 5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
 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
 7. ダイワ“RICI”ファンドの受益証券
 8. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前8. の証券または証書の性質を有するもの
 10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 11. 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。）
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は、次のとおりです。

投資先ファンドの 名 称	ダイワ“RICI”ファンド
運 用 の 基 本 方 針	投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動することをめざします。
主 要 な 投 資 対 象	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資すると

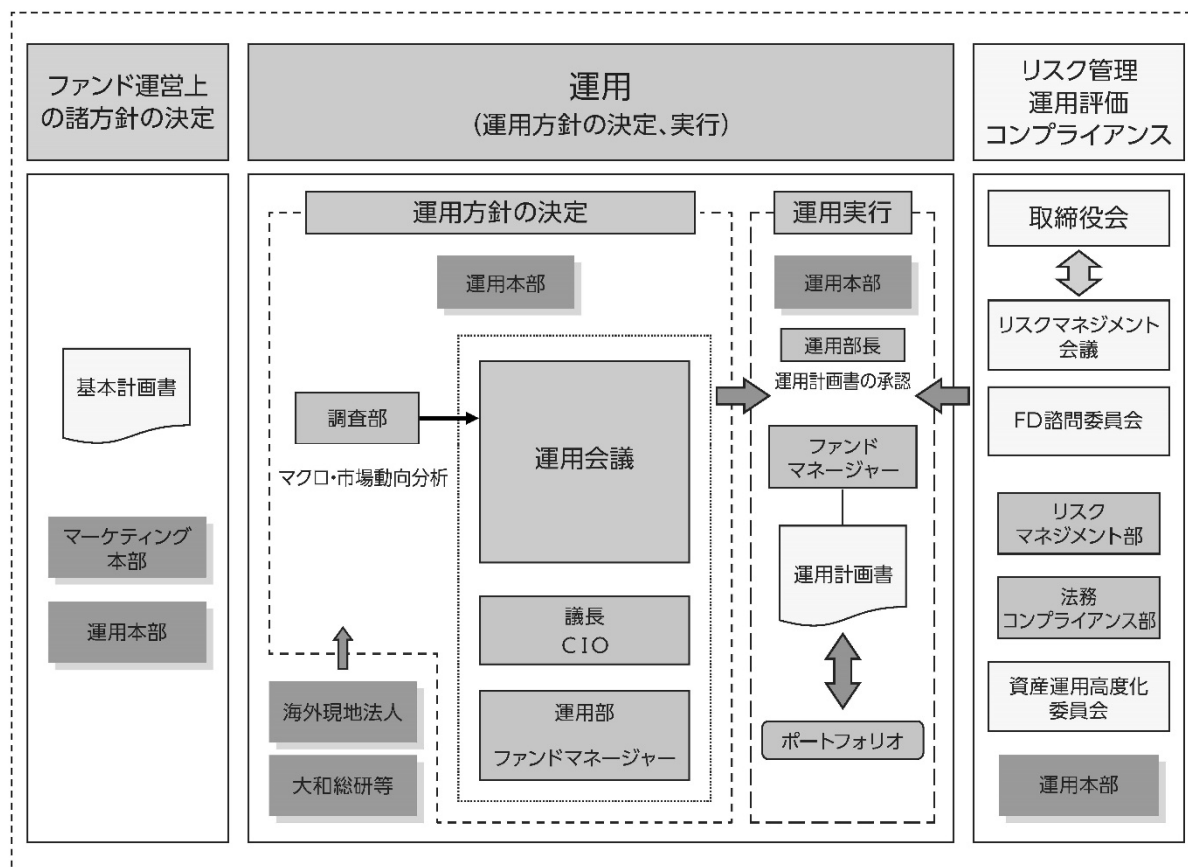
	もに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。
委託会社の名称	管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービシズ・リミテッド（ケイマン） 運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント（シンガポール）リミテッド

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

① 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。



② 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。

③ 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。

④ リスクマネジメント会議、FD 諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. 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。

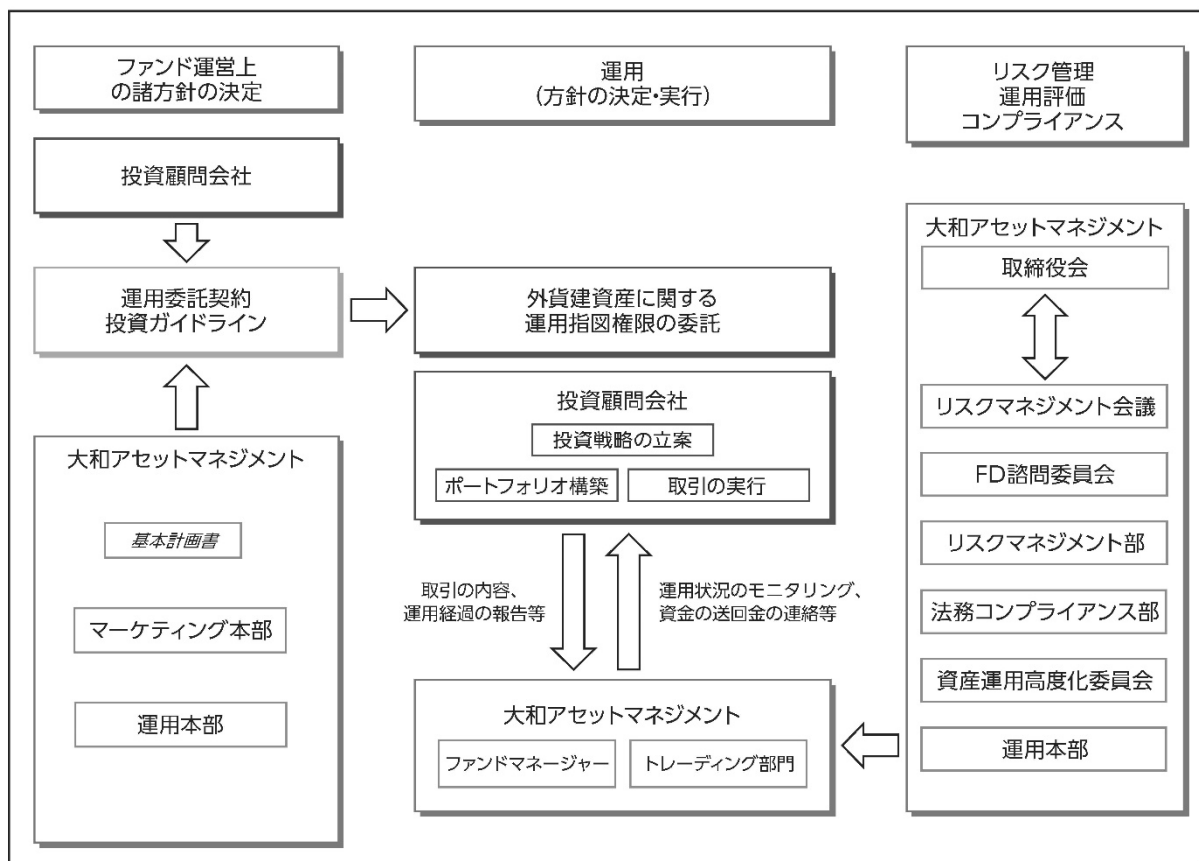
ハ. 資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤ 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（北米）株式および海外（欧州）株式部分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、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」および「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ. 運用の実行

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

ハ. モニタリング

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

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

ニ. リスクマネジメント会議、FD 諮問委員会および資産運用高度化委員会 (前④に同じ。)

※ 上記の運用体制は 2022 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】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、配当等収益等を中心に継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。なお、5 月と 11 月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1 万口当たり。以下「収益分配方針」において同じ。）が 10,000 円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範

囲内で分配する場合があります。なお、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合…500円を上限とします。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合…1,000円を上限とします。

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資制限（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.にかかわらず、委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券で、その約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められているものの時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超える投資の指図をすることができます。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑧ 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。

二. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考>投資対象ファンドについて

※下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

1. ダイワ日本国債マザーファンド

主 な 投 資 制 限	① 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。）の行使等により取得したものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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。 ③ 外貨建資産への投資は、行ないません。
収 益 分 配 方 針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販 売 手 数 料	ありません。
償 還 条 項	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。

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

主 な 投 資 制 限	① 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。）の行使等により取得したものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 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。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収 益 分 配 方 針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販 売 手 数 料	ありません。
償 還 条 項	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。

3. ダイワ好配当日本株マザーファンド

主 な 投 資 制 限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
収 益 分 配 方 針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販 売 手 数 料	ありません。
償 還 条 項	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。

4. ダイワ北米好配当株マザーファンド
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンド
6. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

主 な 投 資 制 限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
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> ① 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 ② 前①の規定にかかわらず、前①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。 <ダイワ欧州好配当株マザーファンド> ① 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 ② (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> 該当事項はありません。
収 益 分 配 方 針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販 売 手 数 料	ありません。
償 還 条 項	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。

7. ダイワ“RICI”ファンド

※「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として内外の株式、内外の公社債およびコモディティ（商品先物取引等）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。

① 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。

② 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。

③ 商品先物取引等による運用に伴うリスク

商品先物等の取引価格は、様々な要因（商品の需給関係の変化、天候、農業生産、貿易動向、為替レート、金利の変動、政治的・経済的事由および政策、疾病、伝染病、技術発展等）に基づき変動します（個々の品目により具体的な変動要因は異なります。）。

当ファンドでは、投資するファンドを通じて商品先物取引等による運用を行ないますので、基準価額は、商品先物ポートフォリオの構成品目の値動きの影響を受けます。

当ファンドの基準価額は、商品先物市場の変動の影響を受け、投資元本を下回ることがあります。

その他、基準価額に影響を与える要因として、次のものが考えられます。

- ・商品先物は、米ドル、カナダ・ドル、豪ドルなど各国の通貨建てで取引されるため、為替変動による影響を受けます。
- ・商品市場は、市場の流動性の不足、投機家の参入および政府の規制・介入等の様々な要因により、一時的に偏向するかその他の混乱を生じることがあります。
- ・各々の商品先物の上場市場が定める値幅制限（1 営業日に発生する先物契約の変動額を制限する規則）などの規制・規則によって、不利な価格での契約の清算を迫られる可能性があります。
- ・当ファンドによる建玉が市場の一定割合を超えた場合に、取引所による建玉規制が行なわれ、指数の構成どおりに組入れができなくなる可能性があります。
- ・値段の低い期近の先物を値段の高い期先の先物に買換える場合、マイナスの影響を及ぼす可能性があります。

④ 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。

⑤ 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。

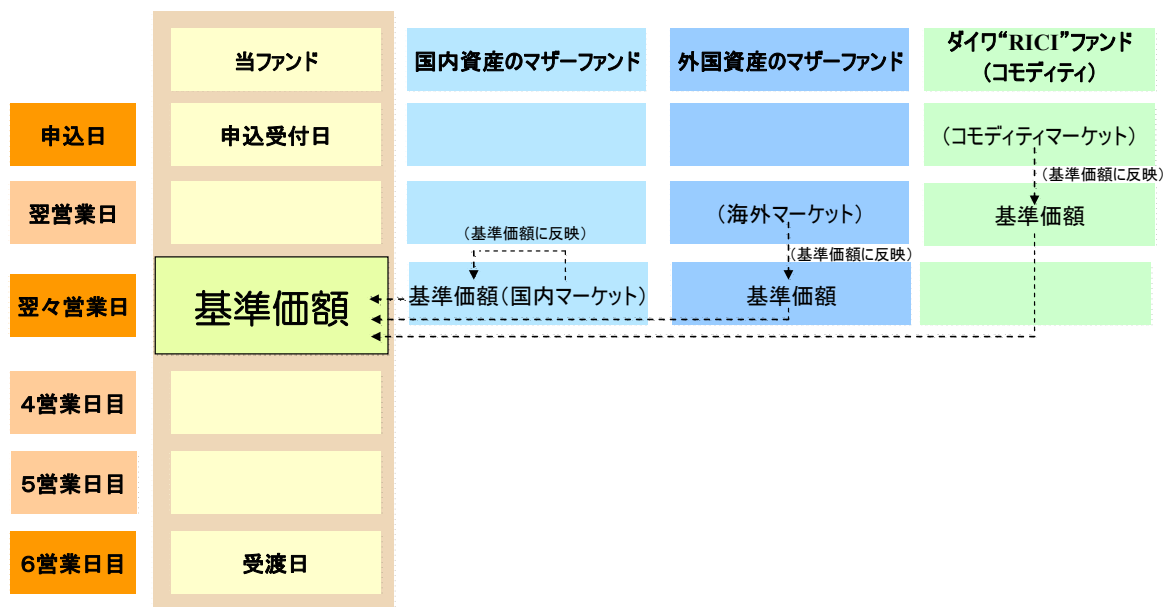
(2) 換金性等が制限される場合

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（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。）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を中止することがあります。ご換金の申込みの受付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。

◎基準価額適用日および解約代金の受渡日について原則として下記のようになります。

- ・当ファンドの追加設定または解約申込みに対する基準価額の適用日は申込日の翌々営業日です。
- ・解約申込時の解約代金の受渡日は申込日から起算して6営業日目以降です。
- ・当ファンドの基準価額は、組入れている投資信託証券の基準価額をもって毎営業日計算されます。
- ・当ファンドの基準価額に用いる投資信託証券の基準価額は、国内資産のマザーファンドについては当日の国内マーケットが反映された当日の基準価額、外国資産のマザーファンドについては前営業日の海外マーケットが反映された当日の基準価額です。また「ダイワ“RICI”ファンド」に関しては、前々営業日の海外マーケットが反映された前営業日の基準価額です。ただし、「ダイワ“RICI”ファンド」のファンド営業日は東京証券取引所およびロンドン、ニューヨークの銀行のいずれかが営業日の日であり、いずれかの市場が休業日の場合、基準価額は算出されません。そのため、前営業日が休業日の場合、その直近のファンド営業日の基準価額を用いることとなります。



(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。

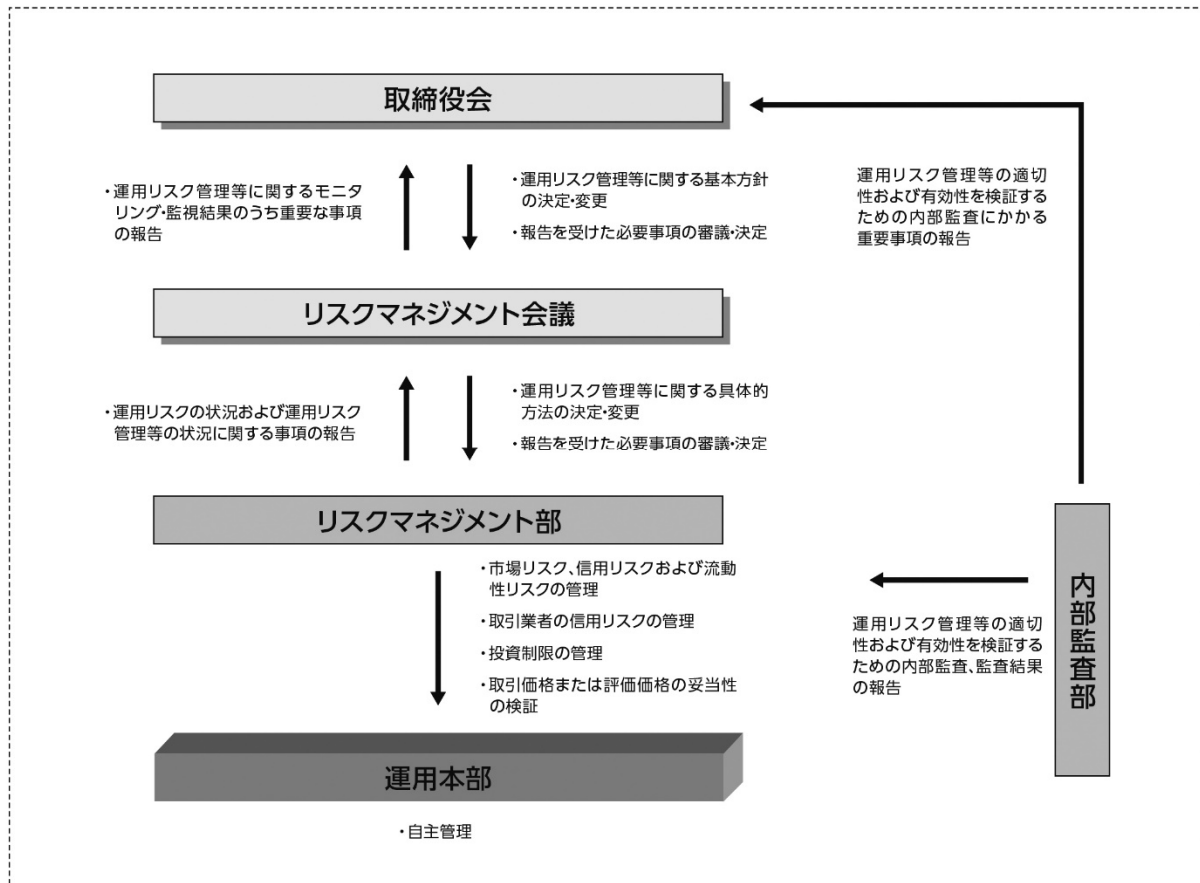
※ 流動性リスクに関する事項

- ・ 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・検証などを行ないます。
- ・ 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。

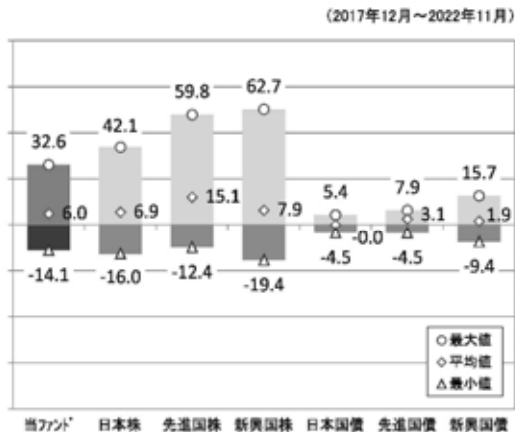
参考情報

- 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年間に於ける年間騰落率（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年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※指数について

●東証株価指数（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が基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI国債は、野村證券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野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(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】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

- ① 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年率 1.485%（税抜 1.35%）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。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.65% (税抜)	年率 0.65% (税抜)	年率 0.05% (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。

- ④ 前③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。
- ⑤ 委託会社は、「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」の各投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該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。
- ⑥ 投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率 1.685%（税込）程度です（当ファンドにおける実際の投資信託証券の組入状況により変動します。）。

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】

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

<投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各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。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(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。

① 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）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

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

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

② 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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

- ① 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。
- ② 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、2022年11月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	151,929,604	18.52
内 ケイマン諸島	151,929,604	18.52
親投資信託受益証券	666,403,073	81.25
内 日本	666,403,073	81.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,807,748	0.22
純資産総額	820,140,425	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】（2022年11月30日現在）

①【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	154,122,362	1.8707 288,316,702	1.8688 288,023,870	35.12
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	45,736,859	3.6224 165,677,198	3.7107 169,715,762	20.69
3	DAIWA RICIFUND	ケイマン諸島	投資信託受益証券	11,896.29	13,289.02 158,090,051	12,771.17 151,929,604	18.52
4	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	19,413,482	2.9135 56,561,179	2.9696 57,650,276	7.03
5	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	25,272,380	2.2420 56,660,675	2.2707 57,385,993	7.00
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,512,873	4.6523 53,561,339	4.6141 53,121,547	6.48
7	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	32,652,661	1.2434 40,600,318	1.2405 40,505,625	4.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	18.52%
親投資信託受益証券	81.25%
合計	99.78%

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【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 13 特定期間末 (2013 年 5 月 10 日)	3,372,265,613	3,386,433,677	0.8331	0.8366
第 14 特定期間末 (2013 年 11 月 11 日)	2,826,036,326	2,838,532,137	0.7916	0.7951
第 15 特定期間末 (2014 年 5 月 12 日)	2,615,870,672	2,626,894,130	0.8306	0.8341
第 16 特定期間末 (2014 年 11 月 10 日)	2,438,285,558	2,445,128,906	0.8908	0.8933
第 17 特定期間末 (2015 年 5 月 11 日)	2,106,332,670	2,112,162,760	0.9032	0.9057
第 18 特定期間末 (2015 年 11 月 10 日)	1,853,001,272	1,856,294,425	0.8440	0.8455
第 19 特定期間末 (2016 年 5 月 10 日)	1,618,028,115	1,621,254,105	0.7523	0.7538
第 20 特定期間末 (2016 年 11 月 10 日)	1,561,397,528	1,563,530,863	0.7319	0.7329
第 21 特定期間末 (2017 年 5 月 10 日)	1,576,785,224	1,578,754,950	0.8005	0.8015
第 22 特定期間末 (2017 年 11 月 10 日)	1,515,682,218	1,517,446,577	0.8591	0.8601
第 23 特定期間末 (2018 年 5 月 10 日)	1,392,998,583	1,394,652,872	0.8421	0.8431
第 24 特定期間末 (2018 年 11 月 12 日)	1,258,210,178	1,259,756,691	0.8136	0.8146
第 25 特定期間末 (2019 年 5 月 10 日)	1,160,207,954	1,161,695,550	0.7799	0.7809
第 26 特定期間末 (2019 年 11 月 11 日)	1,141,101,845	1,142,522,000	0.8035	0.8045
第 27 特定期間末 (2020 年 5 月 11 日)	917,677,333	918,998,336	0.6947	0.6957
第 28 特定期間末 (2020 年 11 月 10 日)	990,117,394	991,395,428	0.7747	0.7757
第 29 特定期間末 (2021 年 5 月 10 日)	990,251,297	991,330,396	0.9177	0.9187
第 30 特定期間末 (2021 年 11 月 10 日)	908,354,327	909,302,662	0.9578	0.9588
2021 年 11 月末日	876,163,020	—	0.9336	—

	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)
12 月末日	900,827,746	—	0.9624	—
2022 年 1 月末日	860,312,650	—	0.9570	—
2 月末日	853,667,371	—	0.9660	—
3 月末日	892,108,565	—	1.0290	—
4 月末日	880,240,577	—	1.0319	—
第 31 特定期間末 (2022 年 5 月 10 日)	861,814,131	867,742,584	1.0176	1.0246
5 月末日	883,641,397	—	1.0411	—
6 月末日	873,370,519	—	1.0335	—
7 月末日	850,706,870	—	1.0323	—
8 月末日	849,105,590	—	1.0366	—
9 月末日	814,503,650	—	0.9968	—
10 月末日	845,229,440	—	1.0404	—
第 32 特定期間末 (2022 年 11 月 10 日)	835,559,604	844,487,170	1.0295	1.0405
11 月末日	820,140,425	—	1.0167	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第 13 特定期間	0.0105
第 14 特定期間	0.0105
第 15 特定期間	0.0105
第 16 特定期間	0.0095
第 17 特定期間	0.0075
第 18 特定期間	0.0065
第 19 特定期間	0.0045
第 20 特定期間	0.0040
第 21 特定期間	0.0030
第 22 特定期間	0.0030
第 23 特定期間	0.0030
第 24 特定期間	0.0030
第 25 特定期間	0.0030
第 26 特定期間	0.0030
第 27 特定期間	0.0030
第 28 特定期間	0.0030
第 29 特定期間	0.0030
第 30 特定期間	0.0030
第 31 特定期間	0.0090
第 32 特定期間	0.0130

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 13 特定期間	36.7

	収益率(%)
第 14 特定期間	△3.7
第 15 特定期間	6.3
第 16 特定期間	8.4
第 17 特定期間	2.2
第 18 特定期間	△5.8
第 19 特定期間	△10.3
第 20 特定期間	△2.2
第 21 特定期間	9.8
第 22 特定期間	7.7
第 23 特定期間	△1.6
第 24 特定期間	△3.0
第 25 特定期間	△3.8
第 26 特定期間	3.4
第 27 特定期間	△13.2
第 28 特定期間	11.9
第 29 特定期間	18.8
第 30 特定期間	4.7
第 31 特定期間	7.2
第 32 特定期間	2.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 13 特定期間	80,023,659	497,359,212
第 14 特定期間	60,242,422	538,029,012
第 15 特定期間	48,791,311	469,463,422
第 16 特定期間	42,853,299	455,073,722
第 17 特定期間	33,393,329	438,696,400
第 18 特定期間	29,536,461	166,137,284
第 19 特定期間	35,191,350	79,966,689
第 20 特定期間	31,240,696	48,565,438
第 21 特定期間	25,904,022	189,512,877
第 22 特定期間	23,628,613	228,995,410
第 23 特定期間	22,527,421	132,597,227
第 24 特定期間	23,044,261	130,820,279
第 25 特定期間	25,409,697	84,327,166
第 26 特定期間	28,046,001	95,487,123
第 27 特定期間	19,781,667	118,933,847
第 28 特定期間	19,227,544	62,196,116
第 29 特定期間	15,238,084	214,172,872
第 30 特定期間	13,013,355	143,777,130
第 31 特定期間	12,585,848	113,999,765
第 32 特定期間	13,286,823	48,611,810

(参考) マザーファンド
ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況 (2022 年 11 月 30 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		118,451,076,270	99.20
	内 日本	118,451,076,270	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		956,766,619	0.80
純資産総額		119,407,842,889	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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 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	130 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	115.39 5,192,640,000	113.10 5,089,770,000	1.800000 2031/09/20	4.26
2	140 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	115.22 5,185,305,000	113.06 5,087,790,000	1.700000 2032/09/20	4.26
3	121 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	115.17 5,182,785,000	112.62 5,068,260,000	1.900000 2030/09/20	4.24
4	12 30年国債	日本	国債証券	4,100,000,000	120.59 4,944,190,000	117.42 4,814,261,000	2.100000 2033/09/20	4.03
5	16 30年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	126.48 4,933,032,000	122.35 4,771,962,000	2.500000 2034/09/20	4.00
6	27 30年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	125.46 4,767,650,000	123.56 4,695,394,000	2.500000 2037/09/20	3.93
7	20 30年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	127.85 4,858,452,000	122.95 4,672,290,000	2.500000 2035/09/20	3.91
8	63 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	102.38 4,607,130,000	101.05 4,547,610,000	1.800000 2023/06/20	3.81
9	24 30年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	129.01 4,644,360,000	123.35 4,440,744,000	2.500000 2036/09/20	3.72
10	80 20年国債	日本	国債証券	4,173,000,000	106.91 4,461,402,300	105.39 4,398,175,080	2.100000 2025/06/20	3.68
11	70 20年国債	日本	国債証券	4,038,000,000	105.52 4,261,053,600	103.79 4,191,201,720	2.400000 2024/06/20	3.51
12	1 30年国債	日本	国債証券	3,550,000,000	120.49 4,277,395,000	117.60 4,175,048,500	2.800000 2029/09/20	3.50
13	88 20年国債	日本	国債証券	3,760,000,000	109.85 4,130,684,000	108.10 4,064,860,800	2.300000 2026/06/20	3.40

	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 (%)
14	102 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	114.81 4,133,172,000	112.47 4,049,208,000	2.400000 2028/06/20	3.39
15	95 20年国債	日本	国債証券	3,605,000,000	112.01 4,037,984,500	110.04 3,966,942,000	2.300000 2027/06/20	3.32
16	94 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	110.46 3,976,848,000	108.70 3,913,200,000	2.100000 2027/03/20	3.28
17	101 20年国債	日本	国債証券	3,460,000,000	114.21 3,951,666,000	111.97 3,874,335,000	2.400000 2028/03/20	3.24
18	86 20年国債	日本	国債証券	3,500,000,000	109.27 3,824,450,000	107.56 3,764,915,000	2.300000 2026/03/20	3.15
19	110 20年国債	日本	国債証券	3,200,000,000	113.90 3,644,920,000	112.13 3,588,224,000	2.100000 2029/03/20	3.01
20	75 20年国債	日本	国債証券	3,374,000,000	106.38 3,589,276,200	104.86 3,538,077,620	2.100000 2025/03/20	2.96
21	68 20年国債	日本	国債証券	3,425,000,000	104.52 3,580,084,000	102.93 3,525,592,250	2.200000 2024/03/20	2.95
22	23 30年国債	日本	国債証券	2,800,000,000	128.70 3,603,600,000	123.34 3,453,688,000	2.500000 2036/06/20	2.89
23	19 30年国債	日本	国債証券	2,700,000,000	124.89 3,372,030,000	120.40 3,250,908,000	2.300000 2035/06/20	2.72
24	26 30年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	124.57 3,238,820,000	122.17 3,176,550,000	2.400000 2037/03/20	2.66
25	145 20年国債	日本	国債証券	2,800,000,000	115.83 3,243,240,000	113.21 3,170,076,000	1.700000 2033/06/20	2.65
26	15 30年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	126.12 3,153,000,000	122.17 3,054,325,000	2.500000 2034/06/20	2.56
27	134 20年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	115.83 3,011,660,000	113.77 2,958,150,000	1.800000 2032/03/20	2.48
28	125 20年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	118.16 2,954,090,000	115.71 2,892,800,000	2.200000 2031/03/20	2.42
29	116 20年国債	日本	国債証券	2,100,000,000	116.10 2,438,150,000	114.26 2,399,523,000	2.200000 2030/03/20	2.01
30	59 20年国債	日本	国債証券	2,195,000,000	101.38 2,225,291,000	100.09 2,197,063,300	1.700000 2022/12/20	1.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.20%
合計	99.20%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況 (2022 年 11 月 30 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		16,090,683,702	92.54
	内 ユーロ	4,429,275,120	25.47
	内 ノルウェー	276,476,560	1.59
	内 スウェーデン	356,300,841	2.05
	内 デンマーク	528,442,288	3.04
	内 イギリス	2,075,028,918	11.93
	内 ポーランド	1,054,881,439	6.07
	内 カナダ	1,175,149,460	6.76
	内 アメリカ	3,975,614,680	22.87
特殊債券		2,219,514,396	12.77
	内 オーストラリア		
特殊債券		924,973,389	5.32
	内 カナダ	924,973,389	5.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		371,654,997	2.14
純資産総額		17,387,312,088	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)		694,343,163	3.99
	内 日本	694,343,163	3.99
為替予約取引(売建)		691,618,998	△3.98
	内 日本	691,618,998	△3.98

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

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

(注 3) 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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 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	19,807,400	79.21 2,178,792,746	80.69 2,219,749,978	0.875000 2030/11/15	12.77
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラ リア	国債証券	19,000,000	105.42 1,858,618,032	107.69 1,898,691,249	4.500000 2033/04/21	10.92

	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 (%)
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	92.34 1,211,319,538	94.37 1,237,908,648	1.400000 2028/04/30	7.12
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,210,400	100.97 900,401,034	110.23 982,944,707	3.250000 2045/05/25	5.65
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,307,800	91.59 802,374,434	92.58 811,011,441	2.250000 2027/08/15	4.66
6	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,660,000	98.06 796,905,268	98.81 803,024,619	1.950000 2026/04/30	4.62
7	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	8,946,000	79.35 725,198,186	82.43 753,374,443	0.500000 2030/12/01	4.33
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	61.35 654,854,202	63.02 672,700,375	1.125000 2040/08/15	3.87
9	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	6,630,000	94.73 641,680,179	95.44 646,489,157	2.250000 2025/12/15	3.72
10	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	79.16 607,826,890	82.08 630,231,221	2.750000 2028/04/25	3.62
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	84.64 450,241,269	91.91 488,923,655	1.625000 2028/10/22	2.81
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,020,000	89.45 449,062,099	94.36 473,705,996	1.500000 2026/07/22	2.72
13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	69.23 356,287,217	78.23 402,601,056	0.250000 2031/07/31	2.32
14	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	98.39 383,782,001	99.03 386,278,398	1.750000 2025/11/15	2.22
15	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	106.85 299,170,897	116.77 326,959,011	3.750000 2045/06/22	1.88
16	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	91.47 313,573,205	93.12 319,246,737	1.100000 2029/05/15	1.84
17	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,815,000	96.40 277,250,512	96.83 278,484,231	2.550000 2025/03/15	1.60
18	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	99.59 276,865,760	99.45 276,476,560	3.000000 2024/03/14	1.59
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	97.44 262,226,488	98.90 266,133,689	3.250000 2029/04/21	1.53
20	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	91.05 151,357,401	112.88 187,642,086	4.250000 2046/12/07	1.08
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,100,000	52.83 159,308,614	62.02 187,004,478	0.750000 2053/05/25	1.08
22	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,800,000	45.94 137,461,903	61.59 184,288,894	1.250000 2051/07/31	1.06
23	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	94.47 176,642,084	95.65 178,850,344	1.000000 2026/11/12	1.03
24	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	99.28 177,815,856	99.08 177,450,496	1.500000 2023/11/13	1.02

	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 (%)
25	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,000,000	63.31 155,561,915	67.31 165,392,180	1.250000 2030/10/25	0.95
26	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,700,000	90.50 157,185,317	94.65 164,387,494	2.750000 2048/12/01	0.95
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	900,000	98.05 146,694,151	109.56 163,922,893	4.250000 2032/06/07	0.94
28	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	102.40 156,919,292	106.78 163,631,204	3.500000 2045/12/01	0.94
29	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	1,172,000	96.09 161,701,226	96.52 162,419,763	1.000000 2026/05/15	0.93
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,400,000	76.38 153,547,610	80.34 161,495,050	— 2032/05/25	0.93

(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	92.54%
特殊債券	5.32%
合計	97.86%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2022 年 12 月	買建	1,082,839	101,290,000	100,195,101	0.58%
		米ドル買/円売 2022 年 12 月	買建	2,091,158	289,400,000	289,228,062	1.66%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2022 年 12 月	買建	22,000,000	309,309,753	304,920,000	1.75%
		ユーロ売/円買 2022 年 12 月	売建	2,700,000	390,690,000	387,099,000	△2.23%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2022 年 12 月	売建	10,041,416	309,309,753	304,519,998	△1.75%

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

(注 2) 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 (2022 年 11 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		15,738,813,690	93.34
	内 日本	15,738,813,690	93.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,122,517,641	6.66
純資産総額		16,861,331,331	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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 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	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	173,400	3,971.00 688,571,400	3,820.00 662,388,000	3.93
2	東京海上HD	日本	株式	保険業	214,800	2,569.50 551,928,600	2,827.00 607,239,600	3.60
3	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	802,300	680.42 545,906,919	755.10 605,816,730	3.59
4	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	123,800	3,779.00 467,840,200	4,287.00 530,730,600	3.15
5	日 立	日本	株式	電気機器	71,900	6,422.00 461,741,800	7,299.00 524,798,100	3.11
6	KDDI	日本	株式	情報・通信業	108,600	4,227.00 459,052,200	4,111.00 446,454,600	2.65
7	三井住友トラスト HD	日本	株式	銀行業	97,400	4,226.00 411,612,400	4,407.00 429,241,800	2.55
8	BIPROGY	日本	株式	情報・通信業	126,400	3,202.49 404,795,267	3,285.00 415,224,000	2.46
9	オリックス	日本	株式	その他金融業	181,800	2,097.00 381,234,600	2,210.50 401,868,900	2.38
10	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	8,300	37,671.62 312,674,483	45,090.00 374,247,000	2.22
11	東 レ	日本	株式	繊維製品	497,000	724.70 360,175,900	738.60 367,084,200	2.18
12	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	164,100	1,976.50 324,343,650	2,128.00 349,204,800	2.07
13	富士電機	日本	株式	電気機器	57,100	5,320.00 303,772,000	5,620.00 320,902,000	1.90

	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 (%)
14	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	157,800	2,000.00 315,600,000	2,010.50 317,256,900	1.88
15	富士フイルム HLDGS	日本	株式	化学	43,200	6,778.00 292,809,600	7,315.00 316,008,000	1.87
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	68,600	4,074.67 279,522,386	4,605.00 315,903,000	1.87
17	三井不動産	日本	株式	不動産業	113,500	2,882.50 327,163,750	2,776.50 315,132,750	1.87
18	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	167,200	1,681.00 281,063,200	1,794.00 299,956,800	1.78
19	T D K	日本	株式	電気機器	56,000	4,704.39 263,446,377	4,880.00 273,280,000	1.62
20	上 組	日本	株式	倉庫・運輸 関連業	96,800	2,824.46 273,407,957	2,799.00 270,943,200	1.61
21	AGC	日本	株式	ガラス・土 石製品	58,200	4,565.00 265,683,000	4,600.00 267,720,000	1.59
22	豊田合成	日本	株式	輸送用機器	114,900	2,300.13 264,285,674	2,282.00 262,201,800	1.56
23	デンソー	日本	株式	輸送用機器	32,900	7,092.95 233,358,199	7,514.00 247,210,600	1.47
24	IHI	日本	株式	機械	65,700	3,201.47 210,336,596	3,760.00 247,032,000	1.47
25	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	109,000	1,939.39 211,393,566	2,176.00 237,184,000	1.41
26	信越化学	日本	株式	化学	12,900	14,720.00 189,888,000	17,570.00 226,653,000	1.34
27	MS&AD	日本	株式	保険業	52,200	3,860.00 201,492,000	4,100.00 214,020,000	1.27
28	電通グループ	日本	株式	サービス業	45,700	4,440.00 202,908,000	4,400.00 201,080,000	1.19
29	アサヒグループホールディング	日本	株式	食料品	43,800	4,383.00 191,975,400	4,398.00 192,632,400	1.14
30	光通信	日本	株式	情報・通信 業	9,600	18,100.00 173,760,000	19,170.00 184,032,000	1.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.34%
合計	93.34%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	1.13%

業種	投資比率
食料品	1.62%
繊維製品	3.06%
化学	8.76%
医薬品	2.07%
ガラス・土石製品	1.79%
鉄鋼	0.44%
非鉄金属	0.97%
金属製品	1.29%
機械	3.10%
電気機器	10.36%
輸送用機器	7.86%
精密機器	0.73%
その他製品	0.39%
電気・ガス業	1.34%
陸運業	0.26%
倉庫・運輸関連業	2.41%
情報・通信業	10.27%
卸売業	9.60%
小売業	2.51%
銀行業	7.20%
証券、商品先物取引業	0.55%
保険業	5.70%
その他金融業	3.28%
不動産業	3.42%
サービス業	3.25%
合計	93.34%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2022 年 11 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		3,404,582,716	72.22
	内 カナダ	97,169,548	2.06
	内 アメリカ	3,307,413,168	70.16
ハイブリッド優先証券		915,928,838	19.43
	内 アメリカ	915,928,838	19.43
投資証券		29,278,767	0.62
	内 アメリカ	29,278,767	0.62
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		364,497,248	7.73
純資産総額		4,714,287,569	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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 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	11,002	19,216.83 211,423,570	19,604.27 215,686,265	4.58
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	6,173	31,740.12 195,931,805	33,374.62 206,021,573	4.37
3	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,541	59,311.37 91,398,832	72,405.42 111,576,767	2.37
4	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,590	15,440.95 70,873,985	18,964.08 87,045,160	1.85
5	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	6,283	14,845.20 93,272,410	12,834.36 80,638,318	1.71
6	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,651	39,986.22 66,017,262	45,379.93 74,922,279	1.59
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,056	22,838.56 69,794,640	24,453.61 74,730,258	1.59
8	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	14,012	4,402.17 61,683,332	5,138.19 71,996,318	1.53
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	5,329	13,700.63 73,011,262	13,219.03 70,444,239	1.49

	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 (%)
10	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケー ーション・サ ービス	13,129	5,052.09 66,328,897	5,324.27 69,902,417	1.48
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	865	71,258.36 61,638,484	73,323.36 63,424,706	1.35
12	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,164	41,659.61 48,491,788	53,285.80 62,024,680	1.32
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	2,829	17,369.85 49,139,333	20,202.80 57,153,743	1.21
14	ELEVANCE HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	784	65,375.82 51,254,651	71,568.04 56,109,346	1.19
15	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケー ーション・サ ービス	3,691	17,603.16 64,973,268	15,200.71 56,105,821	1.19
16	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,391	33,767.62 46,970,772	37,690.70 52,427,773	1.11
17	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,525	12,519.13 44,129,935	14,628.56 51,565,694	1.09
18	MOTOROLA SOLUTIONS INC	アメリカ	株式	情報技術	1,362	29,618.19 40,339,980	36,725.56 50,020,213	1.06
19	PHILLIPS 66	アメリカ	株式	エネルギー	3,130	13,067.66 40,901,798	15,132.66 47,365,238	1.00
20	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	626	71,049.22 44,476,888	74,955.08 46,921,882	1.00
21	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・サ ービス	2,066	18,651.62 38,534,267	22,517.77 46,521,714	0.99
22	WILLIS TOWERS WATSON PLC	アメリカ	株式	金融	1,403	28,055.90 39,362,436	33,120.49 46,468,054	0.99
23	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サ ービス	1,788	22,452.50 40,145,073	25,675.67 45,908,106	0.97
24	DEERE & CO	アメリカ	株式	資本財・サ ービス	749	49,596.03 37,147,428	61,237.50 45,866,890	0.97
25	CARDINAL HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,181	9,454.26 39,528,301	10,922.12 45,665,407	0.97
26	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	3,553	10,456.91 37,153,405	12,648.27 44,939,337	0.95
27	KLA CORP	アメリカ	株式	情報技術	859	44,146.49 37,921,900	51,983.20 44,653,575	0.95
28	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,340	28,976.61 38,828,663	33,298.24 44,619,653	0.95
29	RGA FR	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	—	12,175	3,501.46 42,631,729	3,643.94 44,365,077	0.94
30	NIKE INC -CL B	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,936	12,158.06 35,696,089	14,754.93 43,320,497	0.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	72.22%
ハイブリッド優先証券	19.43%
投資証券	0.62%
合計	92.27%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.66%
素材	2.61%
資本財・サービス	6.37%
一般消費財・サービス	7.03%
生活必需品	5.21%
ヘルスケア	10.48%
金融	9.24%
情報技術	18.91%
コミュニケーション・サービス	5.91%
公益事業	1.80%
合計	72.22%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2022 年 11 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,500,416,842	96.63
	内 スウェーデン	5,017,592	0.32
	内 イギリス	317,147,538	20.42
	内 オランダ	114,686,384	7.39
	内 フランス	328,272,924	21.14
	内 ドイツ	301,744,359	19.43
	内 スイス	313,586,337	20.20
	内 スペイン	22,392,665	1.44
	内 イタリア	97,569,043	6.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		52,349,030	3.37
純資産総額		1,552,765,872	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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,885	15,391.49 90,578,932	16,207.24 95,379,632	6.14
2	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	953	58,020.36 55,293,404	65,842.84 62,748,227	4.04
3	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,385	47,546.68 65,852,163	45,048.44 62,392,100	4.02
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	22,308	2,560.89 57,128,397	2,794.64 62,342,854	4.01
5	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,865	17,499.53 50,136,155	19,940.39 57,129,218	3.68
6	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,954	14,955.29 44,177,935	19,107.62 56,443,928	3.64
7	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	6,645	7,494.87 49,803,451	8,462.60 56,234,012	3.62
8	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,630	11,069.46 51,251,615	12,134.31 56,181,860	3.62

	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 (%)
9	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	4,107	11,711.82 48,100,447	12,662.32 52,004,149	3.35
10	AXA SA	フランス	株式	金融	12,793	3,405.71 43,569,345	3,927.63 50,246,181	3.24
11	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	12,408	3,773.42 46,820,608	3,990.35 49,512,277	3.19
12	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,094	35,306.32 38,625,116	43,289.37 47,358,571	3.05
13	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,845	23,180.99 42,768,928	24,803.44 45,762,356	2.95
14	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	45,791	762.66 34,923,111	848.27 38,843,208	2.50
15	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	92,764	392.11 36,374,339	417.96 38,771,769	2.50
16	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	3,161	10,771.37 34,048,306	12,168.40 38,464,328	2.48
17	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	50,801	590.54 30,000,253	733.11 37,243,202	2.40
18	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	81	413,994.14 33,533,525	455,364.42 36,884,518	2.38
19	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	93,308	335.95 31,346,899	387.31 36,139,672	2.33
20	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,208	24,038.16 29,038,102	29,520.04 35,660,218	2.30
21	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財・サービス	9,094	3,277.21 29,802,980	3,796.25 34,523,145	2.22
22	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,287	4,775.47 30,023,385	5,433.06 34,157,693	2.20
23	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	106,084	245.80 26,082,490	306.47 32,511,723	2.09
24	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	4,736	6,453.04 30,561,638	6,856.15 32,470,756	2.09
25	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	4,209	6,326.13 26,626,701	7,691.58 32,373,863	2.08
26	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	1,845	16,676.81 30,768,727	17,222.42 31,775,367	2.05
27	GSK	イギリス	株式	ヘルスケア	13,419	2,244.43 30,118,105	2,356.80 31,626,019	2.04
28	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	18,856	1,448.19 27,307,179	1,676.42 31,610,756	2.04
29	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	13,646	1,691.65 23,084,386	2,038.26 27,814,118	1.79
30	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	オランダ	株式	生活必需品	6,864	3,944.14 27,072,595	4,011.62 27,535,795	1.77

(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	96.63%
合計	96.63%

(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	8.60%
素材	6.18%
資本財・サービス	9.51%
一般消費財・サービス	5.02%
生活必需品	12.85%
ヘルスケア	14.09%
金融	23.98%
情報技術	2.95%
コミュニケーション・サービス	7.57%
公益事業	5.88%
合計	96.63%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2022 年 11 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		687,991,256	95.77
	内 韓国	106,076,894	14.77
	内 中国	21,099,882	2.94
	内 台湾	129,636,843	18.05
	内 香港	85,743,677	11.94
	内 シンガポール	121,657,110	16.93
	内 オーストラリア	223,776,850	31.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,406,371	4.23
純資産総額		718,397,627	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 (2022 年 11 月 30 日現在)

① 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	29,000	1,868.23 54,178,897	2,186.72 63,415,095	8.83
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	7,210	5,906.51 42,585,988	6,350.88 45,789,845	6.37
3	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	29,000	1,206.14 34,978,484	1,354.83 39,290,244	5.47
4	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	3,700	9,176.93 33,954,645	10,029.67 37,109,783	5.17
5	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	11,000	2,651.39 29,165,598	3,112.03 34,232,352	4.77
6	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	7,050	3,713.45 26,179,863	4,158.84 29,319,877	4.08
7	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	9,900	2,883.91 28,550,741	2,940.51 29,111,099	4.05
8	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	7,800	3,342.30 26,070,736	3,531.34 27,544,514	3.83
9	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	10,600	2,181.40 23,123,395	2,211.18 23,438,568	3.26
10	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	820	26,021.09 21,337,302	28,076.39 23,022,647	3.20

	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 (%)
11	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,930	4,159.21 20,505,403	4,487.32 22,122,509	3.08
12	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	6,378	3,154.21 20,118,077	3,417.45 21,796,532	3.03
13	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,080	14,930.83 16,125,306	16,516.62 17,837,950	2.48
14	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	2,000	10,008.40 20,016,800	8,771.76 17,543,520	2.44
15	SHENG SIONG GROUP LTD	シンガポール	株式	生活必需品	102,000	162.67 16,602,241	165.70 16,901,971	2.35
16	CAPITALAND INVESTMENT LTD	シンガポール	株式	不動産	42,800	324.33 13,881,684	370.81 15,870,959	2.21
17	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	香港	株式	金融	35,500	458.72 16,284,702	443.61 15,748,191	2.19
18	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	2,600	4,384.54 11,399,825	5,334.00 13,868,400	1.93
19	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	134,000	88.90 11,913,399	102.60 13,748,543	1.91
20	SANTOS LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	19,134	723.76 13,848,462	680.15 13,014,003	1.81
21	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポール	株式	コミュニケーション・サービス	46,600	250.57 11,676,991	275.83 12,854,107	1.79
22	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	57,000	173.77 9,904,932	200.48 11,427,784	1.59
23	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	23,000	471.47 10,843,833	449.02 10,327,460	1.44
24	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	1,950	4,029.56 7,857,642	4,585.00 8,940,750	1.24
25	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	台湾	株式	金融	69,260	109.78 7,603,736	117.64 8,147,971	1.13
26	SANDS CHINA LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	20,800	288.74 6,005,942	353.46 7,352,101	1.02
27	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	中国	株式	生活必需品	8,000	904.11 7,232,904	916.55 7,332,472	1.02
28	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	1,350	4,899.40 6,614,190	5,407.68 7,300,368	1.02
29	KEPPEL CORP LTD	シンガポール	株式	資本財・サービス	9,500	674.94 6,411,998	760.83 7,227,896	1.01
30	WILMAR INTERNATIONAL LTD	シンガポール	株式	生活必需品	17,000	356.67 6,063,410	413.25 7,025,311	0.98

(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	95.77%
合計	95.77%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.85%
素材	5.58%
資本財・サービス	2.02%
一般消費財・サービス	4.99%
生活必需品	4.35%
ヘルスケア	3.20%
金融	40.52%
情報技術	24.15%
コミュニケーション・サービス	3.13%
公益事業	0.77%
不動産	2.21%
合計	95.77%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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

●ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド

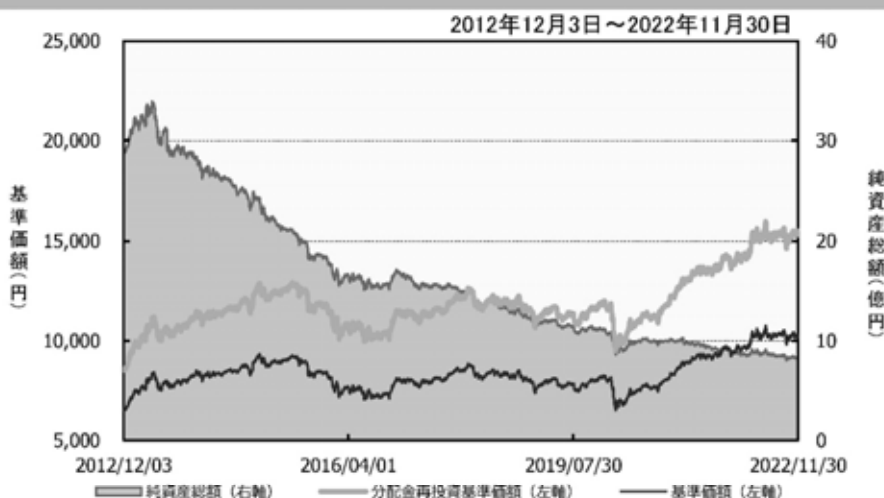
2022年11月30日現在

※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	10,167円
純資産総額	8.2億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.2%
3カ月間	-0.8%
6カ月間	-1.1%
1年間	11.3%
3年間	30.9%
5年間	25.6%
設定来	53.0%



※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: 220円						設定来分配金合計額: 3,295円						
決算期	第 85 期	第 86 期	第 87 期	第 88 期	第 89 期	第 90 期	第 91 期	第 92 期	第 93 期	第 94 期	第 95 期	第 96 期
	21年1月	21年3月	21年5月	21年7月	21年9月	21年11月	22年1月	22年3月	22年5月	22年7月	22年9月	22年11月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	70円	10円	10円	110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を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(除く債券)	国・地域名	比率
外国債券	41	34.4%	米ドル	33.6%	直接利回り(%)	DAIWA RICI FUND	ケイマン諸島	18.5%
国内株式	100	19.3%	日本円	26.0%	最終利回り(%)	日本電信電話	日本	0.8%
外国投資信託	1	18.5%	ユーロ	12.4%	修正デュレーション	東京海上HD	日本	0.7%
外国株式	162	18.2%	豪ドル	6.9%	残存年数	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%
国内債券	33	4.9%	英ポンド	5.8%	債券格付別構成	伊藤忠	日本	0.7%
外国優先出資証券	59	1.3%	カナダ・ドル	4.5%	AAA	日立	日本	0.6%
外国リート	2	0.0%	ポーランド・ズロチ	1.5%	AA	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.6%
			スイス・フラン	1.4%	A	KDDI	日本	0.5%
			台湾ドル	1.4%	BBB	三井住友トラストHD	日本	0.5%
コール・ローン、その他	3.4%	その他	6.4%	BB	-	BIPROGY	日本	0.5%
合計	398	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	24.3%

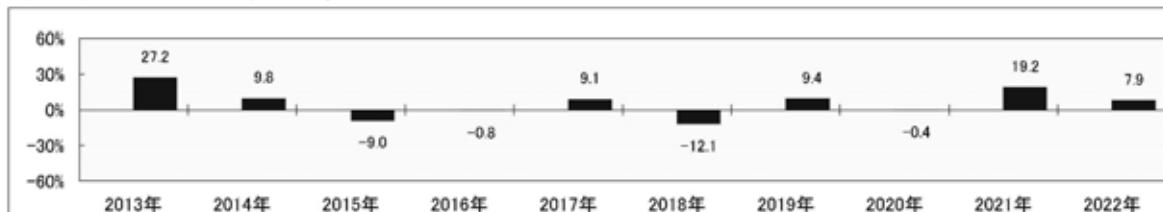
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

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

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。

・2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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、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々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。

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

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとしします。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】

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

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ないません。

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します。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額としします。

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）

ホームページ

0120-106212（営業日の 9:00～17:00）

<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付けたものとして、当該計算日の翌々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 6 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の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）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）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ダイワ“RICI”ファンドの受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・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。

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）

ホームページ

0120-106212（営業日の 9:00～17:00）

<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)①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、2006年11月10日から2007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】

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

② 信託約款の変更

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

4. 前 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1. の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前 1. から前 5. までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。）を持分にに応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きま

す。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

(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（2022年5月11日から2022年11月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年1月6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	深井 康治
-------------------------	-------	-------

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」に掲げられているダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンドの2022年5月11日から2022年11月10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、ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンドの2022年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

1 【財務諸表】

ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド

(1) 【貸借対照表】

	前 期 2022 年 5 月 10 日現在 金 額 (円)	当 期 2022 年 11 月 10 日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	19,009	21,461
コール・ローン	17,374,659	13,620,007
投資信託受益証券	178,783,717	166,673,611
親投資信託受益証券	670,401,549	661,377,411
未収入金	6,878,262	6,252,361
流動資産合計	873,457,196	847,944,851
資産合計	873,457,196	847,944,851
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	4,874
未払収益分配金	5,928,453	8,927,566
未払解約金	3,484,478	1,414,252
未払受託者報酬	81,254	74,176
未払委託者報酬	2,112,926	1,929,003
その他未払費用	35,954	35,376
流動負債合計	11,643,065	12,385,247
負債合計	11,643,065	12,385,247
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	846,921,965	811,596,978
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	14,892,166	23,962,626
(分配準備積立金)	113,176,173	119,993,011
元本等合計	861,814,131	835,559,604
純資産合計	861,814,131	835,559,604
負債純資産合計	873,457,196	847,944,851

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期 自 2021 年 11 月 11 日 至 2022 年 5 月 10 日 金 額 (円)	当 期 自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日 金 額 (円)
営業収益		
受取利息	—	57
有価証券売買等損益	41,395,128	7,554,931
為替差損益	27,086,339	20,054,809
その他収益	365	—
営業収益合計	68,481,832	27,609,797
営業費用		
支払利息	522	1,121
受託者報酬	240,253	236,328
委託者報酬 ※1	6,247,559	6,145,768
その他費用 ※2	389,433	534,431
営業費用合計	6,877,767	6,917,648
営業利益	61,604,065	20,692,149
経常利益	61,604,065	20,692,149
当期純利益	61,604,065	20,692,149
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,323,987	271,571
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△39,981,555	14,892,166
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,525,387	364,934
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,525,387	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	—	364,934
剰余金減少額又は欠損金増加額	215,421	1,123,294
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	—	1,123,294
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	215,421	—
分配金 ※3	7,716,323	10,591,758
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	14,892,166	23,962,626

(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 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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	前 期 2022 年 5 月 10 日現在	当 期 2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	948,335,882 円 12,585,848 円 113,999,765 円	846,921,965 円 13,286,823 円 48,611,810 円

2.	特定期間末日における受益権 の総数	846,921,965 口	811,596,978 口
----	----------------------	---------------	---------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 2021 年 11 月 11 日 至 2022 年 5 月 10 日	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. ※1 投資信託財産（親投資信託）の 運用の指図に係る権限の全部ま たは一部を委託するために要す る費用	285,357 円	286,740 円
2. ※2 その他費用	主に、海外カストディアンに対 するカストディフィーでありま す。	主に、海外カストディアンに対 するカストディフィーでありま す。
3. ※3 分配金の計算過程	（自 2021 年 11 月 11 日 至 2022 年 1 月 11 日） 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 （1,398,809 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 （6,238,786 円）、投資信託約款 に規定される収益調整金 （2,665,769 円）及び分配準備積 立金（67,931,907 円）より分配 対象額は 78,235,271 円（1 万口 当たり 863.79 円）であり、うち 905,724 円（1 万口当たり 10 円）を分配金額としておりま す。 （自 2022 年 1 月 12 日 至 2022 年 3 月 10 日） 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 （1,651,912 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 （16,419,504 円）、投資信託約 款に規定される収益調整金 （2,933,212 円）及び分配準備積 立金（72,385,604 円）より分配 対象額は 93,390,232 円（1 万口 当たり 1,058.67 円）であり、う ち 882,146 円（1 万口当たり 10	（自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 7 月 11 日） 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 （745,557 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（33,728 円）、投資信託約款に規定され る収益調整金（4,067,953 円）及 び分配準備積立金（112,295,405 円）より分配対象額は 117,142,643 円（1 万口当たり 1,384.47 円）であり、うち 846,120 円（1 万口当たり 10 円）を分配金額としておりま す。 （自 2022 年 7 月 12 日 至 2022 年 9 月 12 日） 計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 （2,159,432 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 （19,730,022 円）、投資信託約 款に規定される収益調整金 （4,395,821 円）及び分配準備積 立金（108,048,364 円）より分配 対象額は 134,333,639 円（1 万口 当たり 1,642.07 円）であり、う ち 818,072 円（1 万口当たり 10

	円)を分配金額としております。	円)を分配金額としております。
	(自2022年3月11日至2022年5月10日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,226,326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(29,344,741円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,291,465円)及び分配準備積立金(85,533,559円)より分配対象額は122,396,091円(1万口当たり1,445.19円)であり、うち5,928,453円(1万口当たり70円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日至2022年11月10日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,442,194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(4,985,294円)及び分配準備積立金(127,478,383円)より分配対象額は133,905,871円(1万口当たり1,649.91円)であり、うち8,927,566円(1万口当たり110円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期	
	自 2022年5月11日 至 2022年11月10日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引(商品先物取引)に投資しており、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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	2022 年 5 月 10 日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	2022 年 11 月 10 日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	△2, 539, 931	6, 205, 803
親投資信託受益証券	17, 730, 036	△10, 424, 881
合計	15, 190, 105	△4, 219, 078

(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	前 期				当 期			
	2022 年 5 月 10 日 現在				2022 年 11 月 10 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	—	—	—	—	4,245,564	—	4,250,438	△4,874
アメリカ・ドル	—	—	—	—	4,245,564	—	4,250,438	△4,874
合計	—	—	—	—	4,245,564	—	4,250,438	△4,874

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 特定期間末日に対顧客先物売買取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。

- ① 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買取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。
- ② 特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買取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。

- ・ 特定期間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。
 - ・ 特定期間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) 特定期間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、特定期間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。

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期 自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

(1 口当たり情報)

	前 期 2022 年 5 月 10 日現在	当 期 2022 年 11 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0176 円 (10, 176 円)	1. 0295 円 (10, 295 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	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DAIWA RICI FUND	11,896,286	アメリカ・ドル 1,138,403.190	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 1,138,403.190 (166,673,611)	
投資信託受益証券 合計				166,673,611 [166,673,611]	
親投資信託受益証券	日本円	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	154,122,362	日本円 288,316,702	
		ダイワ日本国債マザーファンド	32,652,661	40,600,318	
		ダイワ好配当日本株マザーファンド	45,736,859	165,677,198	
		ダイワ北米好配当株マザーファンド	11,512,873	53,561,339	
		ダイワ欧州好配当株マザーファンド	25,272,380	56,660,675	
		ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19,413,482	56,561,179	
	日本円 小計			日本円	

		661,377,411	
親投資信託受益証券	合計	661,377,411	
合計		828,051,022 [166,673,611]	

投資信託受益証券及び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。

- (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 投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1 銘柄	100%	100%

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。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・外債ソブリン・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」受益証券及び「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。

また、当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」受益証券（米ドル建）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「投資信託受益証券」は、すべて同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及び同ファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

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

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	213,165,643	345,798,889
国債証券	132,497,907,970	119,739,126,770
未収入金	522,260,000	—
未収利息	623,764,004	529,324,445
前払費用	20,534,789	1,808,217
流動資産合計	133,877,632,406	120,616,058,321
資産合計	133,877,632,406	120,616,058,321
負債の部		
流動負債		
未払解約金	176,152,750	63,608,217
流動負債合計	176,152,750	63,608,217
負債合計	176,152,750	63,608,217
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	107,223,954,714	96,954,173,219
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	26,477,524,942	23,598,276,885
元本等合計	133,701,479,656	120,552,450,104
純資産合計	133,701,479,656	120,552,450,104
負債純資産合計	133,877,632,406	120,616,058,321

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 11 日
期首元本額	118,922,870,269 円	107,223,954,714 円
期中追加設定元本額	487,904,503 円	482,727,437 円
期中一部解約元本額	12,186,820,058 円	10,752,508,932 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドV A (適格機関投資家専用)	38,658 円	38,534 円
安定重視ポートフォリオ (奇数 月分配型)	197,908,144 円	197,909,490 円
6 資産バランスファンド (分配 型)	228,833,006 円	219,185,346 円
6 資産バランスファンド (成長 型)	151,975,009 円	150,342,088 円
ダイワ日本国債ファンド (毎月 分配型)	98,263,229,668 円	88,640,505,701 円
世界 6 資産均等分散ファンド (毎月分配型)	63,552,269 円	59,533,759 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・ バランスファンド	33,456,526 円	32,652,661 円
ダイワ日本国債ファンド (年 1 回決算型)	8,202,265,599 円	7,654,005,640 円
目標利回り追求型債券ファンド	82,695,835 円	－円
計	107,223,954,714 円	96,954,173,219 円
2. 期末日における受益権の総数	107,223,954,714 口	96,954,173,219 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△932,055,150	△2,266,523,830
合計	△932,055,150	△2,266,523,830

(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(2022年3月11日から2022年5月10日まで、及び2022年3月11日から2022年11月10日まで)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

2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1口当たり純資産額	1.2469 円	1.2434 円

(1 万口当たり純資産額)	(12,469 円)	(12,434 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 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 30年国債	3,550,000,000	4,189,958,500	
	12 30年国債	4,100,000,000	4,837,836,000	
	15 30年国債	2,700,000,000	3,314,115,000	
	16 30年国債	3,900,000,000	4,791,891,000	
	19 30年国債	2,700,000,000	3,262,761,000	
	20 30年国債	3,800,000,000	4,689,808,000	
	23 30年国債	2,800,000,000	3,466,988,000	
	24 30年国債	3,700,000,000	4,584,707,000	
	26 30年国債	2,600,000,000	3,188,952,000	
	27 30年国債	3,800,000,000	4,714,166,000	
	59 20年国債	2,495,000,000	2,499,915,150	
	61 20年国債	1,000,000,000	1,004,110,000	
	63 20年国債	4,500,000,000	4,552,740,000	
	65 20年国債	200,000,000	204,420,000	
	68 20年国債	3,425,000,000	3,530,318,750	
	70 20年国債	4,038,000,000	4,197,622,140	
	75 20年国債	3,374,000,000	3,545,331,720	
	80 20年国債	4,173,000,000	4,407,606,060	
	86 20年国債	3,500,000,000	3,776,255,000	
	88 20年国債	3,960,000,000	4,294,580,400	
	94 20年国債	3,600,000,000	3,925,692,000	
	95 20年国債	3,605,000,000	3,979,523,450	
	101 20年国債	3,460,000,000	3,887,863,600	
	102 20年国債	3,600,000,000	4,063,788,000	
	110 20年国債	3,200,000,000	3,598,368,000	
	116 20年国債	2,100,000,000	2,406,978,000	
	118 20年国債	400,000,000	453,596,000	
	121 20年国債	4,500,000,000	5,085,855,000	
	125 20年国債	2,500,000,000	2,904,825,000	
	130 20年国債	4,500,000,000	5,111,055,000	
	134 20年国債	2,600,000,000	2,969,668,000	
	140 20年国債	4,500,000,000	5,112,945,000	
	145 20年国債	2,800,000,000	3,184,888,000	
国債証券 合計			119,739,126,770	
合計			119,739,126,770	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「ダイワ・外債ソブリン・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

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	80,309,828	142,349,116
コール・ローン	31,545,031	50,560,248
国債証券	16,981,582,356	16,059,143,440
特殊債券	1,039,151,600	972,963,533
派生商品評価勘定	7,884,804	2,261,250
未収利息	101,555,053	124,102,378
前払費用	6,176,702	3,080,569
差入委託証拠金	144,279,820	158,732,160
流動資産合計	18,392,485,194	17,513,192,694
資産合計	18,392,485,194	17,513,192,694
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,633,915	8,573,526
未払解約金	16,960,584	23,730,899
流動負債合計	21,594,499	32,304,425
負債合計	21,594,499	32,304,425
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	10,020,943,402	9,344,728,210
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	8,349,947,293	8,136,160,059
元本等合計	18,370,890,695	17,480,888,269
純資産合計	18,370,890,695	17,480,888,269
負債純資産合計	18,392,485,194	17,513,192,694

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 11 日
期首元本額	10,533,894,864 円	10,020,943,402 円
期中追加設定元本額	50,327,662 円	79,127,300 円
期中一部解約元本額	563,279,124 円	755,342,492 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ FOFs 用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,260,060,447 円	1,232,081,515 円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	618,927,012 円	582,846,104 円

ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	44,312,351 円	42,644,846 円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	132,239,578 円	129,530,727 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	231,478,253 円	223,940,161 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	323,510,184 円	315,576,186 円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	152,087,892 円	－円
6資産バランスファンド（分配型）	778,701,219 円	728,933,523 円
6資産バランスファンド（成長型）	103,741,839 円	100,451,565 円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	4,033,569,680 円	3,729,179,355 円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	42,898,749 円	40,219,787 円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	167,685,494 円	146,935,806 円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	672,782,449 円	657,007,548 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	158,778,821 円	154,122,362 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	686,394,958 円	653,946,200 円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	14,331,506 円	24,580,463 円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	477,637,247 円	474,208,742 円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	121,805,723 円	108,523,320 円
計	10,020,943,402 円	9,344,728,210 円
2. 期末日における受益権の総数	10,020,943,402 口	9,344,728,210 口

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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。
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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△547,876,813	189,765,504
特殊債券	△7,226,513	△297,047
合計	△555,103,326	189,468,457

(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(2022 年 4 月 12 日から 2022 年 5 月 10 日まで、及び 2022 年 10 月 12 日から 2022 年 11 月 10 日まで)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	2022 年 5 月 10 日 現在				2022 年 11 月 10 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	366,281,068	—	361,312,337	4,968,731	711,893,248	—	710,041,196	1,852,052
イギリス・ポンド	11,217,073	—	11,224,682	△7,609	—	—	—	—
ポーランド・ズロチ	—	—	—	—	314,021,248	—	314,430,446	△409,198
ユーロ	355,063,995	—	350,087,655	4,976,340	397,872,000	—	395,610,750	2,261,250
買 建	334,488,000	—	332,770,158	△1,717,842	711,893,248	—	703,728,920	△8,164,328
アメリカ・ドル	236,929,000	—	239,822,524	2,893,524	294,720,000	—	291,347,768	△3,372,232
オーストラリア・ドル	97,559,000	—	92,947,634	△4,611,366	103,152,000	—	102,731,152	△420,848
ノルウェー・クローネ	—	—	—	—	314,021,248	—	309,650,000	△4,371,248
合計	700,769,068	—	694,082,495	3,250,889	1,423,786,496	—	1,413,770,116	△6,312,276

(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。
 - ① 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。
 - ② 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)

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1口当たり純資産額	1.8332 円	1.8707 円
(1万口当たり純資産額)	(18,332 円)	(18,707 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 20270815	アメリカ・ドル 6,307,800.000	アメリカ・ドル 5,755,362.870	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	4,519,675.440	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	19,807,400.000	15,540,291.810	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,180,000.000	780,086.200	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	1,150,000.000	1,105,794.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 27,701,210.320 (4,055,734,202)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	イギリス・ポンド 3,020,000.000	イギリス・ポンド 2,830,585.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,891,904.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	678,048.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,350,565.010	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	1,056,060.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	900,000.000	957,690.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	315,900.000	327,743.090	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,083,990.000	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 12,176,585.700 (2,027,036,222)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	オーストラリア・ドル 557,000.000	オーストラリア・ドル 585,033.810	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	2,829,791.000	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	20,030,370.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 23,445,194.810 (2,206,896,187)	
	カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 1,483,140.000	

	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,700,000.000	1,476,501.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	8,946,000.000	7,113,948.660	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	885,070.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 10,958,659.660 (1,185,726,975)	
スウェーデン・ク ローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	13,630,000.000	13,522,868.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	13,514,515.600	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 27,037,383.800 (364,193,560)	
デンマーク・クロ ーネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	6,994,680.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	19,906,090.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 26,900,770.000 (530,483,184)	
ノルウェー・クロ ーネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	19,871,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 19,871,000.000 (280,181,100)	
ポーランド・ズロ チ	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,500,000.000	3,162,355.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	6,000,000.000	5,125,800.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	8,000,000.000	5,027,120.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	19,582,000.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 32,897,275.000 (1,023,440,805)	
ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	735,859.050	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	6,210,400.000	6,455,462.380	
	0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,187,823.000	
	FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,400,000.000	1,094,100.000	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,143,557.000	
	1% IRISH TREASURY 20260515	1,172,000.000	1,123,924.560	

		1. 1% IRISH TREASURY 20290515	2, 387, 600. 000	2, 197, 021. 760	
		1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	5, 660, 000. 000	5, 557, 384. 200	
		1. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9, 136, 000. 000	8, 507, 625. 920	
		1. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1, 300, 000. 000	899, 405. 000	
	ユーロ 小計			ユーロ 29, 902, 162. 870 (4, 385, 451, 205)	
国債証券 合計				16, 059, 143, 440 [16, 059, 143, 440]	
特殊債券	カナダ・ドル	2. 55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 2, 815, 000. 000	カナダ・ドル 2, 712, 731. 050	
		2. 25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	6, 630, 000. 000	6, 279, 538. 200	
		カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 8, 992, 269. 250 (972, 963, 533)	
	特殊債券 合計				972, 963, 533 [972, 963, 533]
合計				17, 032, 106, 973 [17, 032, 106, 973]	

- (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 5 銘柄	100%	23.8%
イギリス・ポンド	国債証券 8 銘柄	100%	11.9%
オーストラリア・ドル	国債証券 3 銘柄	100%	13.0%
カナダ・ドル	国債証券 4 銘柄 特殊債券 2 銘柄	100%	12.7%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2 銘柄	100%	2.1%
デンマーク・クローネ	国債証券 2 銘柄	100%	3.1%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1 銘柄	100%	1.6%
ポーランド・ズロチ	国債証券 4 銘柄	100%	6.0%
ユーロ	国債証券 10 銘柄	100%	25.8%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	447,229,657	905,292,879
株式	14,919,209,050	15,412,824,160
未収入金	23,588,067	9,005,943
未収配当金	219,159,200	201,109,890
流動資産合計	15,609,185,974	16,528,232,872
資産合計	15,609,185,974	16,528,232,872
負債の部		
流動負債		
未払金	—	31,918,161
未払解約金	3,519,000	6,076,000
流動負債合計	3,519,000	37,994,161
負債合計	3,519,000	37,994,161
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,567,462,791	4,552,281,685
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,038,204,183	11,937,957,026
元本等合計	15,605,666,974	16,490,238,711
純資産合計	15,605,666,974	16,490,238,711
負債純資産合計	15,609,185,974	16,528,232,872

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 11 日
期首元本額	4,598,298,795 円	4,567,462,791 円
期中追加設定元本額	276,811,374 円	182,891,209 円
期中一部解約元本額	307,647,378 円	198,072,315 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	2,634,879,604 円	2,609,444,757 円
ダイワ・バランス 3 資産（外債・海外リート・好配当日本株）	24,466,030 円	22,480,704 円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	20,712,526 円	19,031,031 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,631,007 円	16,497,466 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	312,123,447 円	288,440,067 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	50,192,870 円	45,736,859 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	53,004,432 円	48,192,825 円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	223,926,583 円	224,232,533 円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6 分散コース）	430,170,560 円	439,550,258 円
D C ダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	800,355,732 円	838,675,185 円
計	4,567,462,791 円	4,552,281,685 円

2. 期末日における受益権の総数	4,567,462,791 口	4,552,281,685 口
------------------	-----------------	-----------------

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△21,287,895	378,882,075
合計	△21,287,895	378,882,075

(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(2022年4月16日から2022年5月10日まで、及び2022年10月18日から2022年11月10日まで)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

2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,4167円 (34,167円)	3,6224円 (36,224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	
オリエンタル白石	294,400	272.00	80,076,800	
大和ハウス	34,400	3,065.00	105,436,000	
ブルボン	22,400	2,090.00	46,816,000	
ディップ	12,800	4,140.00	52,992,000	
アサヒグループホールディング	43,800	4,273.00	187,157,400	
エレマテック	21,700	1,528.00	33,157,600	
パルグループHLDGS	72,900	2,223.00	162,056,700	
太陽化学	22,300	1,470.00	32,781,000	
富士紡ホールディングス	16,100	3,285.00	52,888,500	
ダイワボウHD	86,100	2,093.00	180,207,300	
トヨタ紡織	37,400	1,912.00	71,508,800	
レスターホールディングス	11,100	2,159.00	23,964,900	
TOKAIホールディングス	36,300	882.00	32,016,600	
三洋貿易	84,000	1,144.00	96,096,000	
東急不動産HD	88,900	756.00	67,208,400	
東レ	497,000	722.30	358,983,100	
旭化成	48,000	962.30	46,190,400	
ANDDOホールディングス	46,800	859.00	40,201,200	
コメダホールディングス	16,000	2,434.00	38,944,000	
共和レザー	64,400	491.00	31,620,400	
セーレン	22,700	2,335.00	53,004,500	
ワコールホールディングス	14,600	2,425.00	35,405,000	
SRAホールディングス	7,500	3,240.00	24,300,000	
日本曹達	36,800	4,265.00	156,952,000	
東亜合成	67,400	1,158.00	78,049,200	
大阪ソーダ	34,100	3,990.00	136,059,000	
信越化学	12,900	15,995.00	206,335,500	
東京応化工業	10,900	6,550.00	71,395,000	
住友ベークライト	22,800	4,100.00	93,480,000	
旭有機材	23,100	2,658.00	61,399,800	
電通グループ	45,700	4,460.00	203,822,000	
アステラス製薬	164,100	2,068.50	339,440,850	
日本空調サービス	74,600	704.00	52,518,400	
フルキャストホールディングス	33,000	2,922.00	96,426,000	
富士フイルムHLDGS	43,200	6,795.00	293,544,000	
デクセリアルズ	49,700	3,150.00	156,555,000	
AGC	58,200	4,420.00	257,244,000	
ニチアス	13,900	2,392.00	33,248,800	

大和工業	15,800	4,735.00	74,813,000
昭和電線HLDGS	53,200	1,640.00	87,248,000
三和ホールディングス	79,500	1,255.00	99,772,500
日東精工	77,400	515.00	39,861,000
マルゼン	30,900	1,810.00	55,929,000
ファインシンター	18,900	1,094.00	20,676,600
ツガミ	95,500	1,091.00	104,190,500
ソディック	84,400	778.00	65,663,200
ベルシステム24HLDGS	93,300	1,317.00	122,876,100
豊田自動織機	6,700	7,550.00	50,585,000
フリー	45,400	1,157.00	52,527,800
三精テクノロジーズ	28,500	752.00	21,432,000
日立	71,900	7,083.00	509,267,700
富士電機	57,100	5,840.00	333,464,000
ダイヘン	11,600	3,905.00	45,298,000
IDEC	39,500	3,095.00	122,252,500
TDK	49,400	4,830.00	238,602,000
デンソー	29,800	7,247.00	215,960,600
京セラ	4,400	6,760.00	29,744,000
村田製作所	9,700	7,327.00	71,071,900
IHI	65,700	3,555.00	233,563,500
プレミアグループ	88,700	1,862.00	165,159,400
いすゞ自動車	167,200	1,758.00	293,937,600
トヨタ自動車	157,800	1,958.50	309,051,300
プレス工業	116,000	418.00	48,488,000
ミクニ	67,400	305.00	20,557,000
豊田合成	91,100	2,329.00	212,171,900
萩原電気HLDGS	17,300	2,427.00	41,987,100
アルゴグラフィックス	1,900	3,600.00	6,840,000
ダイトロン	42,500	2,321.00	98,642,500
スター精密	21,800	1,713.00	37,343,400
大日本印刷	27,800	2,918.00	81,120,400
信越ポリマー	63,800	1,231.00	78,537,800
任天堂	37,600	5,756.00	216,425,600
伊藤忠	123,800	4,214.00	521,693,200
東京エレクトロン	8,300	40,920.00	339,636,000
スターゼン	20,800	2,046.00	42,556,800
セイコーグループ	38,900	3,170.00	123,313,000
BIPROGY	126,400	3,105.00	392,472,000
三菱商事	68,600	4,370.00	299,782,000
稲畑産業	13,700	2,413.00	33,058,100
丸井グループ	69,900	2,325.00	162,517,500
三菱UFJフィナンシャルG	802,300	710.70	570,194,610
りそなホールディングス	359,500	574.70	206,604,650
三井住友トラストHD	97,400	4,403.00	428,852,200
SBIホールディングス	35,600	2,648.00	94,268,800
オリックス	181,800	2,066.00	375,598,800
MS&AD	52,200	4,026.00	210,157,200
第一生命HLDGS	54,800	2,423.50	132,807,800
東京海上HD	214,800	2,799.50	601,332,600
三井不動産	113,500	2,718.50	308,549,750

東京建物	80,600	1,941.00	156,444,600	
丸全昭和運輸	13,800	3,055.00	42,159,000	
三井倉庫HOLD	38,200	3,545.00	135,419,000	
上組	70,700	2,833.00	200,293,100	
日本電信電話	173,400	3,931.00	681,635,400	
KDDI	108,600	4,264.00	463,070,400	
光通信	9,600	18,060.00	173,376,000	
関西電力	85,200	1,158.00	98,661,600	
大阪瓦斯	59,500	2,075.00	123,462,500	
シーイーシー	12,100	1,495.00	18,089,500	
日本管財	5,900	2,500.00	14,750,000	
日鉄物産	17,200	5,200.00	89,440,000	
サンドラッグ	23,000	3,395.00	78,085,000	
合計			15,412,824,160	

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

- 第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「ダイワ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

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	222,424,752	244,741,896
コール・ローン	94,044,258	10,680,021
株式	3,135,915,179	3,439,881,488
ハイブリッド優先証券	789,724,441	953,465,166
投資証券	21,506,884	31,907,099
未収入金	34,589,777	430,418
未収配当金	2,360,572	3,986,507
未収利息	1,542,307	2,123,260
流動資産合計	4,302,108,170	4,687,215,855
資産合計	4,302,108,170	4,687,215,855
負債の部		
流動負債		
未払金	35,485,255	—
未払解約金	133,000	—
流動負債合計	35,618,255	—
負債合計	35,618,255	—
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	980,375,949	1,007,515,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,286,113,966	3,679,700,765
元本等合計	4,266,489,915	4,687,215,855
純資産合計	4,266,489,915	4,687,215,855
負債純資産合計	4,302,108,170	4,687,215,855

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2) ハイブリッド優先証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 原則として、株式及び投資証券の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。 (2) 受取利息

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
1. ※1 期首	2021年11月11日	2022年5月11日
期首元本額	944,385,941 円	980,375,949 円
期中追加設定元本額	60,448,001 円	53,537,523 円
期中一部解約元本額	24,457,993 円	26,398,382 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	5,077,793 円	4,873,667 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,352,986 円	4,133,835 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	78,770,023 円	72,782,482 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	12,770,930 円	11,512,873 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	13,287,852 円	12,235,237 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	133,726,756 円	134,636,516 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	257,837,651 円	264,196,886 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	474,551,958 円	503,143,594 円
計	980,375,949 円	1,007,515,090 円
2. 期末日における受益権の総数	980,375,949 口	1,007,515,090 口

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022年5月11日 至 2022年11月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	△258,277,208	179,476,543
ハイブリッド優先証券	△40,787,855	△2,426,203
投資証券	△1,419,214	△1,374,288
合計	△300,484,277	175,676,052

（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（2022 年 4 月 16 日から 2022 年 5 月 10 日まで、及び 2022 年 10 月 18 日から 2022 年 11 月 10 日まで）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

2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1 口当たり純資産額	4.3519 円	4.6523 円

(1 万口当たり純資産額)	(43, 519 円)	(46, 523 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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABORATORIES	1, 061	99. 460	105, 527. 060	
	ADOBE INC	1, 651	298. 870	493, 434. 370	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2, 317	104. 660	242, 497. 220	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	889	280. 130	249, 035. 570	
	CITIGROUP INC	3, 318	45. 360	150, 504. 480	
	DANAHER CORP	954	246. 950	235, 590. 300	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3, 525	97. 260	342, 841. 500	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2, 819	93. 060	262, 336. 140	
	APPLE INC	11, 002	134. 870	1, 483, 839. 740	
	BOEING CO/THE	1, 296	168. 740	218, 687. 040	
	NISOURCE INC	5, 984	24. 890	148, 941. 760	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1, 513	42. 100	63, 697. 300	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	13, 129	37. 620	493, 912. 980	
	JPMORGAN CHASE & CO	4, 590	129. 740	595, 506. 600	
	CATERPILLAR INC	781	225. 540	176, 146. 740	
	MORGAN STANLEY	3, 553	83. 450	296, 497. 850	
	BROADCOM INC	1, 541	469. 470	723, 453. 270	
	DEERE & CO	1, 321	397. 090	524, 555. 890	
	TELEFLEX INC	542	200. 450	108, 643. 900	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	2, 201	73. 460	161, 685. 460	
	COSTCO WHOLESALE CORP	553	489. 970	270, 953. 410	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1, 340	230. 540	308, 923. 600	
	AMAZON.COM INC	6, 283	86. 140	541, 217. 620	
	EOG RESOURCES INC	1, 899	139. 620	265, 138. 380	
	FORD MOTOR CO	10, 276	13. 310	136, 773. 560	
	NEXTERA ENERGY INC	2, 871	78. 200	224, 512. 200	
	GENERAL MOTORS CO	3, 982	38. 060	151, 554. 920	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1, 164	362. 000	421, 368. 000	
	ALPHABET INC-CL A	5, 329	87. 320	465, 328. 280	
	HOME DEPOT INC	839	286. 750	240, 583. 250	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	2, 633	137. 390	361, 747. 870	
	JOHNSON & JOHNSON	3, 056	172. 450	527, 007. 200	
	KLA CORP	859	337. 520	289, 929. 680	
	MCDONALD'S CORP	1, 391	277. 790	386, 405. 890	
	META PLATFORMS INC CLASS A	3, 691	101. 470	374, 525. 770	
	PHILLIPS 66	3, 130	104. 090	325, 801. 700	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	1, 362	253. 620	345, 430. 440	
	MERCK & CO. INC.	2, 148	101. 590	218, 215. 320	
	NIKE INC -CL B	2, 936	92. 100	270, 405. 600	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	1, 159	230. 540	267, 195. 860	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	495	533. 140	263, 904. 300	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2, 630	90. 970	239, 251. 100	
	EVERGY INC	3, 649	60. 130	219, 414. 370	
	PFIZER INC	2, 215	46. 720	103, 484. 800	

	DOW INC	2,377	47.680	113,335.360	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,829	136.480	386,101.920	
	PEPSICO INC	1,414	178.550	252,469.700	
	CHEVRON CORP	1,481	177.930	263,514.330	
	TESLA INC	1,608	177.590	285,564.720	
	AT&T INC	7,958	18.380	146,268.040	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,788	164.010	293,249.880	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	865	540.660	467,670.900	
	ELEVANCE HEALTH INC	784	520.000	407,680.000	
	WALT DISNEY CO/THE	1,849	86.750	160,400.750	
	WASTE MANAGEMENT INC	1,864	158.200	294,884.800	
	WALMART INC	1,403	139.470	195,676.410	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,403	223.480	313,542.440	
	VISA INC-CLASS A SHARES	1,426	193.930	276,544.180	
	NVIDIA CORP	1,553	137.760	213,941.280	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	670	155.550	104,218.500	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	467	484.710	226,359.570	
	MASTERCARD INC - A	820	315.640	258,824.800	
	ONEOK INC	3,841	60.860	233,763.260	
	BANK OF AMERICA CORP	14,012	36.520	511,718.240	
	EATON CORP PLC	2,066	156.300	322,915.800	
	BARRICK GOLD CORP	15,819	15.350	242,821.650	
	CARDINAL HEALTH INC	6,172	80.170	494,809.240	
	INTEL CORP	3,172	27.520	87,293.440	
	TARGET CORP	1,561	152.990	238,817.390	
	MICROSOFT CORP	6,173	224.510	1,385,900.230	
	MEDTRONIC PLC	3,262	79.290	258,643.980	
	CHUBB LTD	825	210.120	173,349.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	4,333	31.390	136,012.870	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 23,042,700.970 (3,373,681,850)	
カナダ・ドル	SUNCOR ENERGY INC	株 8,853	カナダ・ドル 46.650	カナダ・ドル 412,992.450	
	ENBRIDGE INC	3,741	53.150	198,834.150	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 611,826.600 (66,199,638)	
合計				3,439,881,488 [3,439,881,488]	

(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
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		CHS INC 7.5 4	5,317.000	137,922.980	
		CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	1,257.000	29,388.660	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	608.000	14,105.600	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	1,933.000	44,014.410	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6,877.000	134,995.510	
		NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	4,388.000	94,877.770	
		VALLEY NATIONAL BANCORP FR	2,297.000	56,804.810	
		ENBRIDGE INC 6.375 B	1,438.000	34,037.460	

BANK OF AMERICA CORP 6 GG	3,240.000	76,885.200	
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	2,603.000	60,389.600	
AT&T INC 5.625	6,582.000	146,778.600	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	3,116.000	71,823.800	
NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	67,945.800	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	3,131.000	76,615.570	
CITIZENS FINANCIAL GROUP 6.35 D	9,556.000	225,617.160	
CMS ENERGY CORP 5.875	12,484.000	275,521.880	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	4,508.000	94,870.860	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	9,830.000	219,798.800	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100.000	26,059.000	
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	2,180.000	46,543.000	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	4,519.000	100,276.610	
ALLSTATE CORP 5.1 H	4,777.000	95,014.530	
SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	140,505.510	
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	1,622.000	28,709.400	
SOUTHERN CO 4.95 2020	764.000	14,584.760	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	9,610.000	172,499.500	
FIRST HORIZON CORP 6.5	10,027.000	232,004.720	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	8,532.000	214,750.440	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	2,375.000	43,676.250	
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1,403.000	25,857.290	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167.000	52,192.160	
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	9,717.000	172,768.260	
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	2,575.000	42,719.250	
FIRST REPUBLIC BANK 4.25 L	7,880.000	125,055.600	
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	4,812.000	86,231.040	
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10,983.000	245,470.050	
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12,600.000	229,950.000	
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	5,664.000	105,180.480	
KEMPER CORP FR	6,360.000	129,457.800	
WESCO INTERNATIONAL INC FR	5,224.000	140,995.760	
WTFNL FR	6,744.000	168,262.800	
PACWL FR	1,881.000	47,081.430	
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	4,785.000	119,146.500	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	1,269.000	30,011.850	
KEY FR	1,258.000	30,129.100	
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	2,628.000	45,648.360	
RGA FR	12,175.000	305,470.750	
AQNCN FR	7,125.000	166,725.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J	11,823.000	293,269.510	
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	1,884.000	47,382.600	
MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589.000	40,122.250	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	3,790.000	93,158.200	
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	6,543.000	165,668.760	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	6,563.000	164,796.930	
MORGAN STANLEY 6.375 I	9,533.000	232,986.520	
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3,258.000	74,705.940	
CITIGROUP INC 7.125 J	6,132.000	154,833.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル	

				6, 512, 295. 380 (953, 465, 166)	
ハイブリッド優先証券 合計				953, 465, 166 [953, 465, 166]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC 7. 125 J	7, 569	144, 719. 280	
		PUBLIC STORAGE 4. 625 L	3, 915	73, 210. 500	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 217, 929. 780 (31, 907, 099)		
投資証券 合計				31, 907, 099 [31, 907, 099]	
合計				985, 372, 265 [985, 372, 265]	

ハイブリッド優先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 ハイブリッド 優先証券時価 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 73 銘柄				
	ハイブリッド優先証券 57 銘柄	77.4%	21.9%	0.7%	98.5%
	投資証券 2 銘柄				
カナダ・ドル	株式 2 銘柄	100%	-%	-%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	62,210,719	76,078,756
コール・ローン	11,087,924	7,783,437
株式	1,348,827,708	1,483,405,340
未収配当金	6,165,363	598,019
流動資産合計	1,428,291,714	1,567,865,552
資産合計	1,428,291,714	1,567,865,552
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	15,050
未払解約金	115,000	6,763,000
流動負債合計	115,000	6,778,050
負債合計	115,000	6,778,050
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	677,515,208	696,293,431
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	750,661,506	864,794,071
元本等合計	1,428,176,714	1,561,087,502
純資産合計	1,428,176,714	1,561,087,502
負債純資産合計	1,428,291,714	1,567,865,552

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 11 日
期首元本額	688,288,869 円	677,515,208 円
期中追加設定元本額	37,959,818 円	46,716,256 円
期中一部解約元本額	48,733,479 円	27,938,033 円
期末元本額の内訳		

ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,528,618 円	10,114,010 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,079,606 円	9,096,018 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	161,733,283 円	159,502,392 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	26,155,362 円	25,272,380 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	27,119,566 円	25,762,466 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	68,573,109 円	69,170,453 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	132,294,451 円	137,079,783 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	242,031,213 円	260,295,929 円
計	677,515,208 円	696,293,431 円
2. 期末日における受益権の総数	677,515,208 口	696,293,431 口

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
-----	--------------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日 現在	2022 年 11 月 10 日 現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△84,574,792	111,971,885
合計	△84,574,792	111,971,885

(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 (2022 年 4 月 16 日から 2022 年 5 月 10 日まで、及び 2022 年 10 月 18 日から 2022 年 11 月 10 日まで) 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	2022 年 5 月 10 日 現在				2022 年 11 月 10 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	—	—	—	—	14,648,200	—	14,663,250	△15,050
ユーロ	—	—	—	—	14,648,200	—	14,663,250	△15,050
合計	—	—	—	—	14,648,200	—	14,663,250	△15,050

(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。

- ① 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。
- ② 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)

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	2.1080 円 (21,080 円)	2.2420 円 (22,420 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		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	12,408	23.835	295,744.680	
	HALEON PLC	16,774	2.862	48,015.570	
	UNILEVER PLC	4,736	40.700	192,755.200	
	PRUDENTIAL PLC	15,660	9.024	141,315.840	
	AVIVA PLC	32,608	4.263	139,007.900	
	GSK	13,419	14.072	188,832.160	
	M&G PLC	72,546	1.778	129,023.060	
	TESCO PLC	93,308	2.283	213,022.160	
	VODAFONE GROUP PLC	107,247	1.041	111,644.120	
	NATIONAL GRID PLC	18,856	9.866	186,033.290	
	HSBC HOLDINGS PLC	45,791	4.767	218,285.690	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,863,679.670 (310,246,755)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,385	327.800	454,003.000	
	NESTLE SA-REG	5,885	109.120	642,171.200	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	953	436.200	415,698.600	
	NOVARTIS AG-REG	4,630	81.810	378,780.300	
	GIVAUDAN-REG	81	3,008.000	243,648.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 2,134,301.100 (317,562,661)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,623	141.600	371,416.800	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 371,416.800 (5,002,984)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,954	115.760	341,955.040	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,161	80.250	253,670.250	
ユーロ	BASF SE	3,878	47.545	184,379.510	

	ALLIANZ SE-REG	1,208	188.920	228,215.360	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,094	282.300	308,836.200	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	22,308	19.710	439,690.680	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,287	35.775	224,917.420	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,213	12.848	105,520.620	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,864	29.155	200,119.920	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,845	120.250	221,861.250	
	KONINKLIJKE KPN NV	92,764	2.815	261,130.660	
	TOTALENERGIES SE	6,645	56.710	376,837.950	
	MICHELIN (CGDE)	9,094	26.190	238,171.860	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,865	134.560	385,514.400	
	BNP PARIBAS	4,209	50.260	211,544.340	
	CAPGEMINI SE	1,845	165.500	305,347.500	
	AXA SA	12,793	26.500	339,014.500	
	SANOFI	4,107	86.840	356,651.880	
	INTESA SANPAOLO	106,084	2.154	228,504.930	
	ENI SPA	13,646	14.022	191,344.210	
	ENEL SPA	50,801	4.819	244,810.010	
	ENAGAS SA	9,015	16.830	151,722.450	
ユーロ 小計				ユーロ 5,799,760.940 (850,592,940)	
合計				1,483,405,340 [1,483,405,340]	

- (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 11 銘柄	100%	20.9%
スイス・フラン	株式 5 銘柄	100%	21.4%
スウェーデン・クローナ	株式 1 銘柄	100%	0.3%
ユーロ	株式 22 銘柄	100%	57.4%

- 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・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

	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	20,975,847	34,283,208
コール・ローン	5,844,833	5,183,332
株式	649,032,800	677,644,408
未収配当金	1,055,975	811,745
流動資産合計	676,909,455	717,922,693
資産合計	676,909,455	717,922,693
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,720	—
未払解約金	—	2,809,000
流動負債合計	1,720	2,809,000
負債合計	1,720	2,809,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	232,903,188	245,446,403
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	444,004,547	469,667,290
元本等合計	676,907,735	715,113,693
純資産合計	676,907,735	715,113,693
負債純資産合計	676,909,455	717,922,693

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2022 年 5 月 10 日現在	2022 年 11 月 10 日現在
1. ※1 期首	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 11 日
期首元本額	244,476,014 円	232,903,188 円
期中追加設定元本額	10,821,365 円	18,931,614 円
期中一部解約元本額	22,394,191 円	6,388,399 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）	7,880,285 円	7,897,395 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,464,294 円	7,163,917 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	118,411,804 円	121,568,958 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	19,062,752 円	19,413,482 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	20,001,563 円	19,992,659 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	9,426,759 円	10,266,521 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	18,130,615 円	20,454,163 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	33,525,116 円	38,689,308 円
計	232,903,188 円	245,446,403 円
2. 期末日における受益権の総数	232,903,188 口	245,446,403 口

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022 年 5 月 11 日 至 2022 年 11 月 10 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022 年 11 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2022 年 5 月 10 日 現在	2022 年 11 月 10 日 現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	△38,642,520	25,101,464
合計	△38,642,520	25,101,464

(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(2022 年 4 月 16 日から 2022 年 5 月 10 日まで、及び 2022 年 10 月 18 日から 2022 年 11 月 10 日まで)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	2022 年 5 月 10 日 現在				2022 年 11 月 10 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	2,485,720	—	2,484,000	△1,720	—	—	—	—
香港・ドル	2,485,720	—	2,484,000	△1,720	—	—	—	—
合計	2,485,720	—	2,484,000	△1,720	—	—	—	—

(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。
 - ① 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。
 - ② 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)

	2022年5月10日現在	2022年11月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9064円 (29,064円)	2.9135円 (29,135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		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP GROUP LTD	7,050	41.180	290,319.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	6,378	38.890	248,040.420	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	9,900	31.660	313,434.000	
	WESTPAC BANKING CORP	10,600	23.720	251,432.000	
	SANTOS LTD	19,134	7.640	146,183.760	
	RIO TINTO LTD	700	98.630	69,041.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,700	104.770	387,649.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,080	171.450	185,166.000	
	CSL LTD	820	279.610	229,280.200	
	WESFARMERS LTD	4,930	46.240	227,963.200	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,348,508.580 (221,065,112)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	42,800	3.350	143,380.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	11,000	29.140	320,540.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	7,800	34.670	270,426.000	
	SHENG SIONG GROUP LTD	102,000	1.610	164,220.000	
	KEPPEL CORP LTD	9,500	7.080	67,260.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	46,600	2.550	118,830.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	3.950	67,150.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 1,151,806.000 (120,317,655)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA CORP	400	67,400.000	26,960,000.000	
	SK HYNIX INC	2,000	89,200.000	178,400,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	200	169,500.000	33,900,000.000	
	NAVER CORP	190	180,000.000	34,200,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	3,550	49,100.000	174,305,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,210	62,000.000	447,020,000.000	
	SK TELECOM	1,147	51,200.000	58,726,400.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	4,350	41,200.000	179,220,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,132,731,400.000 (121,655,353)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	8,000	45.550	364,400.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,600	260.000	676,000.000	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	23,000	7.580	174,340.000	

	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	80,000	4.450	356,000.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,000	38.000	304,000.000	
	AIA GROUP LTD	29,000	68.050	1,973,450.000	
	SANDS CHINA LTD	20,800	17.160	356,928.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	2,500	82.750	206,875.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	35,500	25.600	908,800.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	5,500	30.200	166,100.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 5,486,893.000 (102,330,555)	
台湾・ドル	株		台湾・ドル	台湾・ドル	
	DELTA ELECTRONICS INC	3,000	274.000	822,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	58.100	581,000.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	134,000	21.200	2,840,800.000	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	69,260	25.300	1,752,278.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	285.000	1,140,000.000	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	7,000	187.000	1,309,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	27,000	417.000	11,259,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	23,000	102.500	2,357,500.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	57,000	41.450	2,362,650.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 24,424,228.000 (112,275,733)	
合計				677,644,408 [677,644,408]	

- (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 10 銘柄	100%	32.5%
シンガポール・ドル	株式 7 銘柄	100%	17.8%
韓国・ウォン	株式 8 銘柄	100%	18.0%
香港・ドル	株式 10 銘柄	100%	15.1%
台湾・ドル	株式 9 銘柄	100%	16.6%

- 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。

「Daiwa “RICI” Fund」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

財政状態計算書
2022 年 4 月 30 日現在

	米ドル
資産	
現金	29,965,354
証拠金	182,061,452
受取勘定	4,068
金融資産(損益通算後の評価額)	597,968,893
資産合計	809,999,767
資本	
受益証券元本	480,405,247
利益剰余金	306,787,703
資本合計	787,192,950
負債	
当座借越	1,703,354
支払勘定	700,084
金融負債(損益通算後の評価額)	20,403,379
負債合計	22,806,817
資本および負債合計	809,999,767

包括利益計算書
2022 年 4 月 30 日に終了した年度

	米ドル
営業収益	
銀行利息収入	9,101
金融資産および負債(損益通算後の評価額)による損益	336,098,713
投資損益合計	336,107,814
営業費用	
運用会社報酬	-
運用会社代理人報酬	3,015,927
投資運用会社報酬	2,979,591
管理会社報酬	1,090,094
受託会社報酬	72,673
保管会社報酬	109,009
仲介手数料	1,001,579
監査報酬	17,229
その他費用	11,287
営業費用合計	8,297,389
当会計年度の営業損益	327,810,425
金融費用	
支払銀行利息	(194,581)
金融費用合計	(194,581)

包括利益(損失)合計

327,615,844

組入資産の明細
2022 年 4 月 30 日現在

債券	元本	評価額 米ドル	純資産に 占める比率 (%)
米国			
US T-Bill 0% 19-May-2022	90,000,000	89,993,751	11.43
US T-Bill 0% 16-Jun-2022	80,000,000	79,983,196	10.16
US T-Bill 0% 14-Jul-2022	85,000,000	84,961,510	10.79
US T-Bill 0% 11-Aug-2022	70,000,000	69,967,800	8.89
US T-Bill 0% 08-Sep-2022	60,000,000	59,893,725	7.61
US T-Bill 0% 06-Oct-2022	80,000,000	79,761,573	10.13
US T-Bill 0% 03-Nov-2022	50,000,000	49,833,375	6.34
US T-Bill 0% 01-Dec-2022	40,000,000	39,693,267	5.04
債券合計		554,088,197	70.39

先物取引	数量	取引金額	評価益	評価(損)
フランス				
Milling Wheat (EOP) – Sep-2022	804	14,269,829	2,094,753	–
Rapeseed (EOP) – Aug-2022	172	7,226,506	638,180	–
		21,496,335	2,732,933	–
日本				
Rubber (OSE) – Oct-2022	755	7,155,177	37,083	–
		7,155,177	37,083	–
英国				
Brent Crude Oil (ICE) Jul-2022	312	64,030,220	1,347,840	–
Brent Crude Oil (ICE) Aug-2022	652	34,464,720	–	(88,020)
Coffee Robusta (ICE) Jul-2022	751	15,636,850	–	(234,810)
Copper Grade A (LME) May-2022	(135)	(34,957,756)	1,975,569	–
Copper Grade A (LME) May-2022	135	33,573,938	–	(591,750)
Copper Grade A (LME) Jun-2022	126	32,659,400	–	(1,885,475)
Copper Grade A (LME) Jun-2022	(87)	(11,807,888)	84,488	–
Copper Grade A (LME) Jul-2022	85	10,183,425	76,125	–
Gas Oil (ICE) Jun-2022	31	6,078,675	617,675	–
Gas Oil (ICE) Jul-2022	59	3,234,750	64,500	–
No 7 Cocoa (ICE) Jul-2022	341	7,349,127	65,173	–
Primary High Grade Aluminium (LME) May-2022	391	33,280,913	–	(3,608,900)
Primary High Grade Aluminium (LME) May-2022	(391)	(34,281,304)	4,609,291	–
Primary High Grade Aluminium (LME) Jun-2022	(260)	(11,093,544)	213,925	–
Primary High Grade Aluminium (LME) Jun-2022	377	32,968,875	–	(4,286,244)
Primary High Grade Aluminium (LME) Jul-2022	270	10,222,875	71,719	–
Primary Nickel (LME) May-2022	56	8,292,726	2,374,266	–
Primary Nickel (LME) May-2022	(56)	(10,895,294)	228,302	–
Primary Nickel (LME) Jun-2022	(29)	(3,173,274)	125,274	–
Primary Nickel (LME) Jun-2022	42	8,214,296	–	(213,296)
Primary Nickel (LME) Jul-2022	26	2,572,362	–	(94,536)
Special High Grade Zinc (LME) May-2022	(182)	(19,197,813)	355,125	–
Special High Grade Zinc (LME) May-2022	182	16,765,925	2,076,763	–

Special High Grade Zinc (LME) Jun-2022	161	17,044,875	—	(440,744)
Special High Grade Zinc (LME) Jun-2022	(111)	(6,396,175)	105,169	—
Special High Grade Zinc (LME) Jul-2022	99	5,074,563	—	(36,444)
Standard Lead (LME) May-2022	283	16,916,275	—	(933,850)
Standard Lead (LME) May-2022	(283)	(17,193,844)	1,211,418	—
Standard Lead (LME) Jun-2022	(187)	(5,886,736)	68,524	—
Standard Lead (LME) Jun-2022	271	16,489,538	—	(1,181,425)
Standard Lead (LME) Jul-2022	183	5,131,831	10,806	—
Tin (LME) May-2022	(37)	(8,169,800)	659,910	—
Tin (LME) May-2022	37	8,370,550	—	(860,660)
Tin (LME) Jun-2022	(26)	(2,883,890)	49,310	—
Tin (LME) Jun-2022	38	8,293,285	—	(599,425)
Tin (LME) Jul-2022	26	2,608,775	12,935	—
White Sugar (ICE) Aug-2022	294	7,646,820	2,945	—
		241,168,271	16,407,052	(15,055,579)

米国

Corn (CBT) Jul-2022	947	35,445,425	4,153,800	—
Cotton No 2 (NYB) Jul-2022	470	31,343,295	3,015,965	—
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) Jul-2022	190	4,529,445	810,877	—
Gasoline Rbob (NYM) Jun-2022	58	14,990,346	812,406	—
Gasoline Rbob (NYM) Jul-2022	112	7,998,917	—	(62,328)
Gold (CMX) Jun-2022	66	25,315,660	—	(231,930)
Gold (CMX) Aug-2022	137	13,098,270	140,070	—
Hard Red Spring Wheat (MGE) Jul-2022	135	7,476,988	658,138	—
Heating Oil (NYM) Jun-2022	33	8,907,587	1,098,682	—
Heating Oil (NYM) Jul-2022	61	4,835,498	—	(21,352)
Henry Hub Natural Gas (NYM) Jun-2022	280	32,201,960	4,057,200	—
Henry Hub Natural Gas (NYM) Jul-2022	420	14,687,400	758,100	—
KC HRW Wheat (CBT) Jul-2022	139	7,349,663	544,250	—
Lean Hogs (CME) Jun-2022	50	4,671,410	—	(212,620)
Lean Hogs (CME) Aug-2022	116	2,638,550	—	(98,220)
Light Sweet Crude Oil (NYM) Jun-2022	370	72,467,820	2,512,300	—
Light Sweet Crude Oil (NYM) Jul-2022	776	40,146,360	—	(205,640)
Live Cattle (CME) Jun-2022	91	9,939,700	—	(161,840)
Live Cattle (CME) Aug-2022	190	5,181,440	—	(40,990)
Lumber (CME) Jul-2022	69	6,430,589	312,961	—
Milk Future (CME) May-2022	11	1,030,080	—	(2,240)
Milk Future (CME) Jun-2022	21	541,760	—	(3,340)
Oat (CBT) Jul-2022	116	3,951,900	—	(245,800)
Palladium (NYM) Jun-2022	4	1,626,470	3,210	—
Palladium (NYM) Sep-2022	7	887,680	38,400	—
Platinum (NYM) Jul-2022	299	14,889,655	—	(1,359,415)
Rough RICE (CBT) Jul-2022	174	5,685,070	428,590	—
Silver (CMX) Jul-2022	258	31,336,375	—	(2,364,700)
Soybean Meal (CBT) Jul-2022	130	5,730,090	—	(283,110)
Soybean Oil (CBT) Jul-2022	325	14,252,244	2,883,792	—
Soybeans (CBT) Jul-2022	324	25,909,725	1,383,225	—
Sugar No 11 World (NYB) Jul-2022	364	7,754,107	—	(54,275)
Wheat (CBT) Jul-2022	400	20,279,088	1,091,662	—
		483,530,567	24,703,628	(5,347,800)

先物取引合計

753,350,350	43,880,696	(20,403,379)
-------------	------------	--------------

投資明細

2022 年 11 月 10 日現在における「ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド」が組入れている Daiwa “RICI” Fund の投資有価証券の状況を示しております。

(1) 有価証券

(単位：US ドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US TREASURY BILL OPCT 01DEC22	90,000,000	89,908,791.46	
US TREASURY BILL OPCT 23MAR23	90,000,000	88,948,955.74	
US TREASURY BILL OPCT 26JAN23	85,000,000	84,545,320.22	
US TREASURY BILL OPCT 20APR23	80,000,000	78,734,937.46	
USA TREASURY BILLS OPCT 23FEB23	45,000,000	44,658,812.53	
US TREASURY BILL OPCT 18MAY23	40,000,000	39,152,916.65	

(2) 商品先物

(単位：US ドル)

銘柄	買建/売建	数量	評価損益	備考
MILLING WHEAT (EOP) MAR-23	買建	730	-690,665.30	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-23	買建	191	74,882.48	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-23	買建	856	1,787,870.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) JAN-23	買建	654	-1,809,570.00	
COPPER GRADE A (LME) NOV-22	買建	130	1,203,862.50	
COPPER GRADE A (LME) NOV-22	売建	130	-1,717,450.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-22	買建	130	1,874,925.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-22	売建	130	-1,732,037.50	
COPPER GRADE A (LME) JAN-23	買建	127	1,782,100.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-23	売建	1	-5,006.25	
GAS OIL (ICE) JAN-23	買建	73	313,675.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-23	買建	284	440,870.04	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-22	買建	426	148,375.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-22	売建	426	-1,877,131.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-22	買建	455	2,013,601.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-22	売建	455	-1,601,707.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-23	買建	433	1,565,200.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-23	売建	4	-3,566.00	
PRIMARY NICKEL (LME) NOV-22	買建	51	857,097.00	
PRIMARY NICKEL (LME) NOV-22	売建	51	-733,023.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-22	買建	46	659,592.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-22	売建	46	-410,652.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-23	買建	46	412,086.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-22	買建	149	-1,697,250.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-22	売建	149	120,537.50	

SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-22	買建	169	-75,568.75	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-22	売建	169	-733,152.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-23	買建	168	756,000.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-23	売建	1	-1,125.00	
STANDARD LEAD (LME) NOV-22	買建	268	772,750.00	
STANDARD LEAD (LME) NOV-22	売建	268	-1,180,737.50	
STANDARD LEAD (LME) DEC-22	買建	263	1,133,475.00	
STANDARD LEAD (LME) DEC-22	売建	263	-476,199.00	
STANDARD LEAD (LME) JAN-23	買建	266	481,590.75	
STANDARD LEAD (LME) JAN-23	売建	3	-1,256.25	
TIN (LME) NOV-22	買建	54	-736,865.00	
TIN (LME) NOV-22	売建	54	193,320.00	
TIN (LME) DEC-22	買建	58	-199,230.00	
TIN (LME) DEC-22	売建	58	-523,103.50	
TIN (LME) JAN-23	買建	66	583,550.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-23	買建	253	312,275.00	
RUBBER (OSE) APR-23	買建	787	284,721.13	
CORN (CBT) MAR-23	買建	848	-918,925.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-23	買建	690	4,460,270.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) JAN-23	買建	124	465,420.00	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) JAN-23	買建	172	528,242.40	
GOLD (CMX) FEB-23	買建	183	1,294,810.00	
HARD RED SPRING WHEAT (MGE) MAR-23	買建	128	-118,187.50	
HEATING OIL (NYM) JAN-23	買建	74	233,755.20	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) JAN-23	買建	601	1,847,550.00	
KC HRW WHEAT FUT (CBT) MAR-23	買建	132	-135,025.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-23	買建	174	-5,730.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) JAN-23	買建	1049	1,680,500.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-23	買建	196	-80,610.00	
LUMBER (CME) JAN-23	買建	105	-92,411.00	
MILK FUTURE (CME) DEC-22	買建	33	131,480.00	
OAT (CBT) MAR-23	買建	168	-100,662.50	
PALLADIUM (NYM) MAR-23	買建	9	67,580.00	
PLATINUM (NYM) JAN-23	買建	229	2,155,460.00	
ROUGH RICE (CBT) JAN-23	買建	141	141,230.00	
SILVER (CMX) MAR-23	買建	250	2,716,740.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) JAN-23	買建	113	-45,350.00	

SOYBEAN OIL (CBT) JAN-23	買建	294	418,974.00	
SOYBEANS (CBT) JAN-23	買建	309	806,762.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-23	買建	310	401,620.80	
WHEAT (CBT) MAR-23	買建	394	-825,812.50	

(注) LME (ロンドン金属取引所) においては、先渡し売買となるため、期日到来まで反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年11月30日

I 資産総額	823,481,838 円
II 負債総額	3,341,413 円
III 純資産総額（I－II）	820,140,425 円
IV 発行済数量	806,670,008 口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0167 円

（参考）ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

I 資産総額	119,543,037,786 円
II 負債総額	135,194,897 円
III 純資産総額（I－II）	119,407,842,889 円
IV 発行済数量	96,255,093,254 口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.2405 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

2022年11月30日

I 資産総額	17,411,816,363 円
II 負債総額	24,504,275 円
III 純資産総額（I－II）	17,387,312,088 円
IV 発行済数量	9,303,848,735 口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.8688 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

2022年11月30日

I 資産総額	16,906,627,163 円
II 負債総額	45,295,832 円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,861,331,331 円
Ⅳ 発行済数量	4,544,008,070 口
Ⅴ 1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7107 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

2022 年 11 月 30 日

Ⅰ 資産総額	4,752,413,240 円
Ⅱ 負債総額	38,125,671 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,714,287,569 円
Ⅳ 発行済数量	1,021,703,214 口
Ⅴ 1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.6141 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

2022 年 11 月 30 日

Ⅰ 資産総額	1,554,954,872 円
Ⅱ 負債総額	2,189,000 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,552,765,872 円
Ⅳ 発行済数量	683,831,197 口
Ⅴ 1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2707 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

2022 年 11 月 30 日

Ⅰ 資産総額	720,181,627 円
Ⅱ 負債総額	1,784,000 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	718,397,627 円
Ⅳ 発行済数量	241,918,872 口
Ⅴ 1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9696 円

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
① 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。
② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
③ 上記①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た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します。）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、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2022 年 11 月末日現在

資本金の額 151 億 7,427 万 2,500 円

発行可能株式総数 799 万 9,980 株

発行済株式総数 260 万 8,525 株

過去 5 年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 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。

② 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。

2022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	81	277,536
追加型株式投資信託	770	21,155,993
株式投資信託 合計	851	21,433,528
単位型公社債投資信託	79	159,741
追加型公社債投資信託	14	1,428,018
公社債投資信託 合計	93	1,587,759
総合計	944	23,021,287

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

2022 年 5 月 23 日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	間瀬	友未
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	深井	康治

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の

執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,860	3,168
有価証券	333	486
前払費用	237	332
未収委託者報酬	13,150	13,811
未収収益	49	52
関係会社短期貸付金	18,700	24,900
その他	207	45
流動資産計	37,539	42,799
固定資産		
有形固定資産	※1 224	※1 203
建物	6	4
器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年 3 月 31 日)	当事業年度 (2022年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	68	65
未払金	8,405	9,856
未払収益分配金	13	26
未払償還金	39	12
未払手数料	4,734	4,917
その他未払金 ※2	3,617	4,900
未払費用	3,777	4,246
未払法人税等	804	980
未払消費税等	631	1,016
賞与引当金	950	866
その他	88	2
流動負債計	14,725	17,033
固定負債		
退職給付引当金	2,452	2,399
役員退職慰労引当金	74	13
その他	3	1
固定負債計	2,530	2,415
負債合計	17,256	19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768
一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年 4 月 1 日 至 2021年 3 月31日)	当事業年度 (自 2021年 4 月 1 日 至 2022年 3 月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	△109	69
法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 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	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	△ 363	△ 363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

当事業年度（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	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別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「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）を適用する予定であります。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

(未適用の会計基準等)

- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

※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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金	3,473百万円	4,694百万円

3 保証債務

前事業年度(2021年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務 1,727 百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2022年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務 1,900 百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020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

2021年6月22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。

- ① 剰余金の配当の総額 9,388百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 3,599円

- ④ 基準日 2021年3月31日
 ⑤ 効力発生日 2021年6月23日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 3月31日	2021年 6月23日

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 剰余金の配当の総額 12,737百万円
 ② 配当の原資 利益剰余金
 ③ 1株当たり配当額 4,883円
 ④ 基準日 2022年3月31日
 ⑤ 効力発生日 2022年6月24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連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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。

②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。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「2019年適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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（2021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
投資有価証券（※1）	85	—	—	85
資産合計	85	—	—	85

(※1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(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、コマーシャル・ペーパー、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。

当事業年度（2022年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券（※1）	66	—	—	66
資産合計	66	—	—	66

（※1）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券486百万円、投資有価証券10,022百万円は上記の表に含めておりません。

（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

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。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,677
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（2021年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2021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	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（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（2022年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
（１）株式	-	-	-
（２）その他 証券投資信託	1,719	327	59

合計	1,719	327	59
----	-------	-----	----

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万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331百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,574 百万円	2,452 百万円
勤務費用	155	152
退職給付の支払額	△ 378	△ 303
その他	101	98
退職給付債務の期末残高	2,452	2,399

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,452 百万円	2,399 百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399
退職給付引当金	2,452	2,399
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	155 百万円	152 百万円
その他	108	67
確定給付制度に係る退職給付費用	263	219

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186百万円、当事業年度189百万円でありま

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 (2021年 3 月31 日)	当事業年度 (2022年 3 月31 日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	750	734
賞与引当金	243	227
未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	△254	△ 356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△ 159
その他有価証券評価差額金	△453	△ 562
繰延税金負債合計	△612	△ 722
繰延税金資産の純額	973	885

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（2021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（2022年 3 月31 日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(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74,402百万円、その他545百万円であります。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

[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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の 名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業 の 内 容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 —	18,700 —

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の 名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業 の 内 容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の 所有(被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品 取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,727	—	—

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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の 所有(被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品 取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,900	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁 (MAS) に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及び MAS への全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(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 2020 年 4 月 1 日 至 2021 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㈱	東京都 千代田区	100,000	金融商品 取引業	—	証券投資信託 受益証券の募 集販売	証券投資信 託の代行手 数料 (注 2)	14,917	未払手数料	3,321
						本社ビルの管 理	不動産の賃 借料 (注 4)	527	長期差入保 証金	1,054
同一の 親会社 をもつ 会社	㈱大和総研 ビジネス・ イノベーション	東京都 江東区	3,000	情報サー ビス業	—	ソフトウェア の開発	ソフトウェ アの購入 (注 3)	883	未払費用	179
同一の 親会社 をもつ 会社	大和プロパ ティ㈱	東京都 中央区	100	不動産管 理業	—	本社ビルの管 理	不動産の賃 借料 (注 4)	527	—	—

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) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の 親会社 をもつ 会社	大和証券(株)	東京都 千代田区	100,000	金融商品 取引業	-	証券投資信託 受益証券の募 集販売 本社ビルの管 理	証券投資信託の代行手数料(注2)	15,348	未払手数料	3,028
							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)	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,784.79円	1株当たり純資産額	16,078.50円
1株当たり当期純利益	3,599.54円	1株当たり当期純利益	4,883.43円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,389	12,738
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2022 年 11 月 28 日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員 公認会計士 間瀬 友未

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員 公認会計士 深井 康治

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

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 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	※1	196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2022年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	5,646
未払費用	4,193
未払法人税等	1,623
賞与引当金	486
その他	※ 2 655
流動負債合計	12,605
固定負債	
退職給付引当金	2,344
役員退職慰労引当金	33
その他	1
固定負債合計	2,379
負債合計	14,984
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,692
利益剰余金合計	7,067
株主資本合計	33,737
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	394
評価・換算差額等合計	394
純資産合計	34,131
負債・純資産合計	49,116

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281
営業収益合計	36,208
営業費用	
支払手数料	15,088
その他営業費用	6,970
営業費用合計	22,059
一般管理費	※1 5,766
営業利益	8,382
営業外収益	※2 579
営業外費用	※3 274
経常利益	8,686
特別利益	—
特別損失	※4 460
税引前中間純利益	8,226
法人税、住民税及び事業税	2,472
法人税等調整額	248
中間純利益	5,505

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15, 174	11, 495	374	13, 925	14, 299	40, 969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12, 737	△12, 737	△12, 737
中間純利益	-	-	-	5, 505	5, 505	5, 505
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	-	-	-	△7, 232	△7, 232	△7, 232
当中間期末残高	15, 174	11, 495	374	6, 692	7, 067	33, 737

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△576	△576	△576
当中間期変動額合計	△576	△576	△7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

であります。

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

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

(連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「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。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)
有形固定資産	326百万円

※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(2022年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

※ 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

※ 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
投資有価証券売却損	244百万円

※ 4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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
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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2022 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	57	7,306	—	7,364
資産合計	57	7,306	—	7,364

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

(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
非上場株式等	666
子会社株式	1,454
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間（2022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 1,454百万円）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	57	55	2
（2）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	2,692	3,171	△478
小計	2,692	3,171	△478
合計	7,364	6,797	567

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 35,926 百万円、その他 281 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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,084.78円
1株当たり中間純利益	2,110.46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おりません。

(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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ① 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。)
- ② 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。)
- ③ 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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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
2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。
・監査役の人数の変更(4名以内から5名以内に変更)
- 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。

追加型証券投資信託

(ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド)

約 款

大和アセットマネジメント株式会社

約款第22条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

下記の各ファンド（1. から6. までは掲げるファンドを、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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
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
7. ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下「ダイワ “RICI” ファンド」といいます。）の受益証券（米ドル建）

(2) 投資態度

① 主として複数の投資信託証券を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

② 各投資信託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。

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券	信託財産の純資産総額の5%
ダイワ・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20%
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6.6%
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6.6%
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6.6%

ダイワ “RICI” ファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の20%

③ 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。

④ 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。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まる場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ただし、約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められている同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%を超えることができます。

④ 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

3. 収益分配方針

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、配当等収益等を中心に継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1万口当たり。以下「収益分配方針」において同じ。）が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。なお、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。
 - ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合…500円を上限とします。
 - ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合…1,000円を上限とします。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

【注記】

「ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド」およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。）はJames Beeland Rogers、Jim Rogers またはBeeland Interests, Inc.（以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。）により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Indexの決定、構成、算出において大和アセットマネジメント株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers」、「Rogers International Commodity Index」および「RICI」は、James Beeland Rogers、Jim Rogers または Beeland Interests, Inc. のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

追加型証券投資信託
(ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

③ 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第 2条 委託者は、金100億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第 3条 委託者は、受託者と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第44条第1項、第45条第1項、第46条第1項および第48条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第 5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第 6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第 7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第 8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、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従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③ 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。

④ 第25条に規定する予約為替の評価は、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。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- ③ 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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。
- ③ 第1項の規定にかかわらず、指定販売会社は、別に定める取引所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の受付を行ないません。
- ④ 第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第35条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。）に社振法の規定に従い、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。

- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第15条 （削 除）

第16条 （削 除）

第17条 （削 除）

第18条 （削 除）

（投資の対象とする資産の種類）

第19条 この信託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

（有価証券および金融商品の指図範囲等）

第20条 委託者は、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次の第1号から第6号までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の第7号に掲げる外国投資信託の受益証券、ならびに次の第8号から第11号までに掲げる有価証券（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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
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
7. ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（「ダイワ “RICI” ファンド」といいます。）の受益証券（米ドル建）
8. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
11. 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。）

- ② 委託者は、信託金を、前項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

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第21条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第26条において同じ。）、第26条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第19条および第20条に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

② 前項の取扱いは、第25条、第30条から第32条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

第22条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

(同一銘柄の投資信託証券への投資制限)

第23条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券で、その約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められているものの時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超える投資の指図をすることができるものとします。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第24条 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。

(外国為替予約取引の指図)

第25条 委託者は、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のための投資制限)

第25条の2 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

第26条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務

2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第27条 (削 除)

(混蔵寄託)

第28条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第29条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券売却等の指図)

第30条 委託者は、信託財産に属する証券投資信託の受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第31条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第32条 委託者は、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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第33条 委託者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、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第34条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信

託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第35条 この信託の計算期間は、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、2006年11月10日から2007年1月10日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

(信託財産に関する報告)

第36条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第37条 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。）、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 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。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第38条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第35条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の135の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、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。
- ③ 第1項の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。
- ④ 委託者は、この信託において主要投資対象とするダイワ北米好配当株マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に年10,000分の50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。
- ⑤ 委託者は、この信託において主要投資対象とするダイワ欧州好配当株マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に年10,000分の50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。

(収益の分配方式)

第39条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。ただし、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

1. 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第40条 収益分配金は、第1計算期間を除く毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、

毎計算期間の末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計算期間の末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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、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指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、6営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第41条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第42条 受益者が、収益分配金については第40条第1項に規定する支払開始日から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第40条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第43条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者により一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める取引所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請求の受付を行ないません。なお、前項の一部解約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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌々営業日の基準価額とします。
- ④ 2007年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、2007年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

- ⑤ 委託者は、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。）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、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付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請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第43条の2 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（信託契約の解約）

第44条 委託者は、信託期間中において、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この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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、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この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、この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。
- ③ 前項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者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 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この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この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、この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 第3項から前項までの規定は、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、第3項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。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第45条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第49条の規定に従います。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第46条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第49条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第47条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第48条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託

者は、第49条の規定に従い、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第49条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、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け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、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この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、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ③ 前項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者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 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

- ⑤ 委託者は、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この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、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第50条 第44条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第44条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第50条の2 委託者は、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の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第51条 委託者が受益者に対してする公告は、2008年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、2008年7月1日以降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 2008年7月1日以降において、前項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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第52条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第40条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条 2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の記名式、無記名式への変更ならびに名義書換手続）から第18条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

2006年11月10日

委託者 大和アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

I 別に定める取引所

約款第12条および第43条の「別に定める取引所」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所
I C E フューチャーズ・ヨーロッパ