DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安　定コース）
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成　長コース）

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10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「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」、「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）」および「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）」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10月3日に関東財務局長に提出しており、2023年10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】

⑴【ファンドの名称】

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

（注）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。

⑵【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もありません。

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なわないものとします。

⑶【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、5,000 億円を上限とし、合計で 1 兆 5,000 億円を上限とします。

⑷【発行（売出）価格】

1 万口当たり取得申込受付日の翌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/

⑸【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

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。

⑹【申込単位】

1 円以上 1 円単位

⑺【申込期間】

2023 年 10 月 4 日から 2024 年 4 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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

1. ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）
2. ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）
3. ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

商品分類表〈各ファンド共通〉

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
	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〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注 1）商品分類の定義

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

（注 2）属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの

	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分固定型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回		目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの
投資対象地域	グローバル		目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本		目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米		目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州		目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア		目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア		目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米		目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ		目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）		目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング		目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング

		地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行な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。

※ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

ファンドの名称	略称
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	安定コース
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	６分散コース
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	成長コース

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

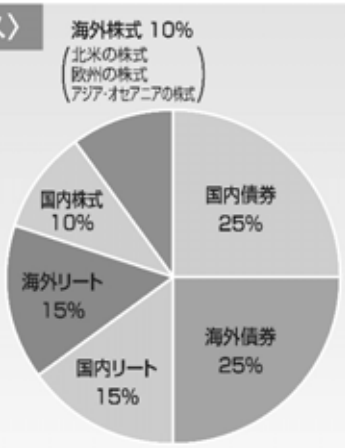
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の債券、リートおよび株式に投資します。

●各コース（安定コース／6分散コース／成長コース）における各資産の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処とします。

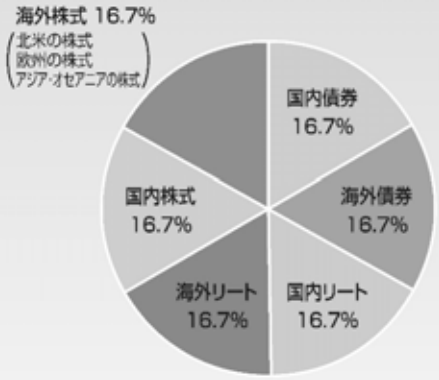
〈安定コース〉



	組入比率	海外	国内
債　券	50%	25%	25%
リート	30%	15%	15%
株　式	20%	10%	10%
合　計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
※海外株式への投資は、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散して行ないます。各地域の時価総額に応じて配分します。

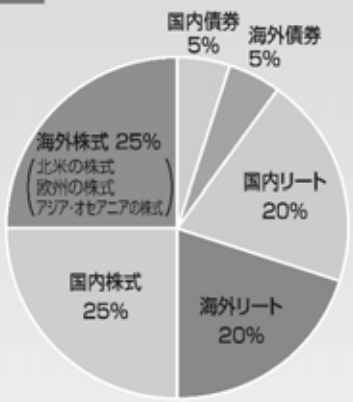
〈6分散コース〉



	組入比率	海外	国内
債　券	33.3%	16.7%	16.7%
リート	33.3%	16.7%	16.7%
株　式	33.3%	16.7%	16.7%
合　計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
※海外株式への投資は、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散して行ないます。各地域の時価総額に応じて配分します。

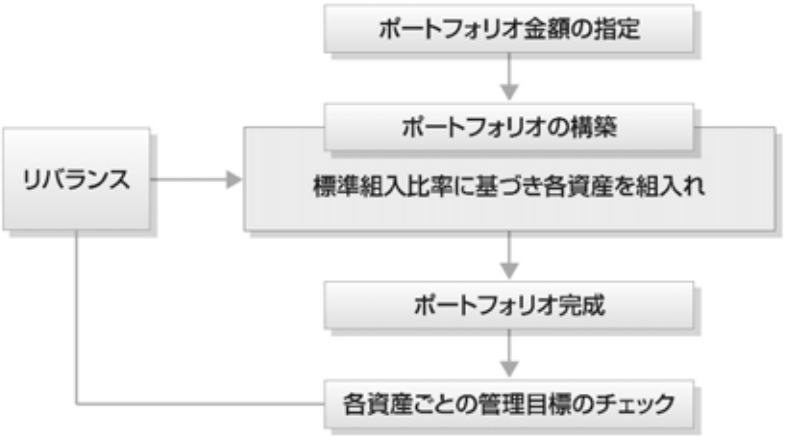
〈成長コース〉



	組入比率	海外	国内
債　券	10%	5%	5%
リート	40%	20%	20%
株　式	50%	25%	25%
合　計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
※海外株式への投資は、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散して行ないます。各地域の時価総額に応じて配分します。

運用プロセス

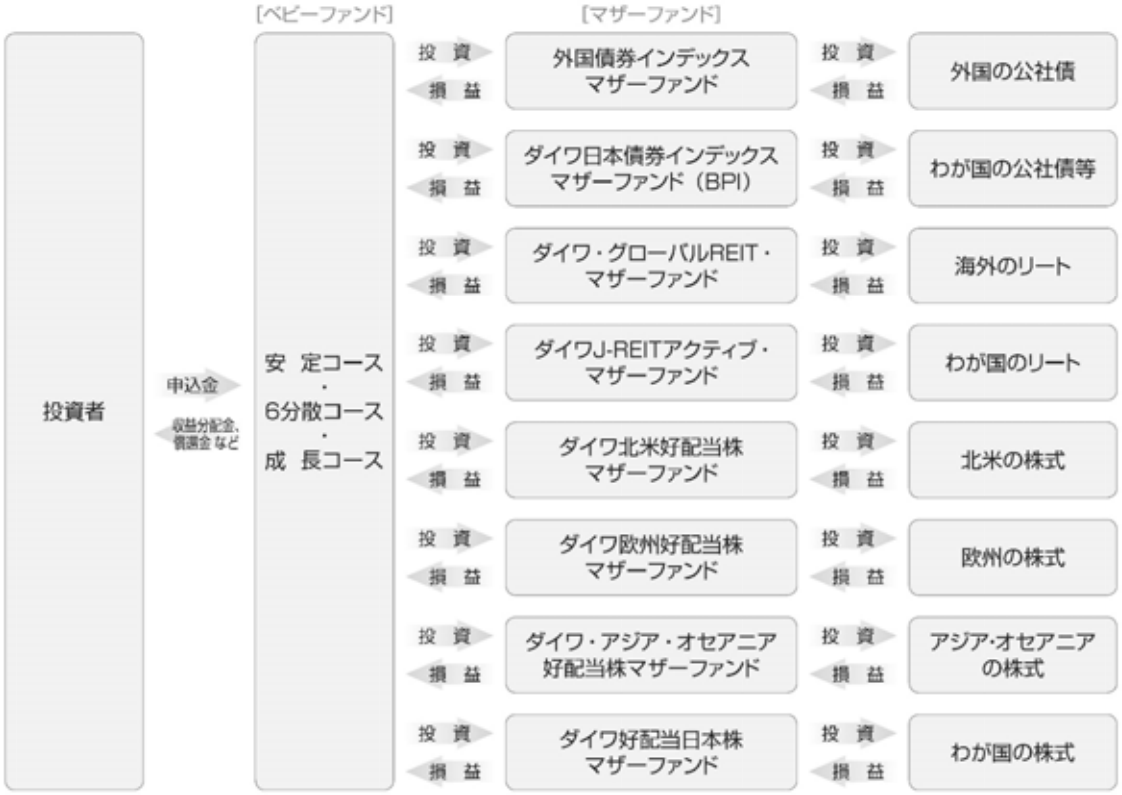


- 標準組入比率に従って、各資産へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- 各資産ごとのウエイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- 各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。

ファンドの仕組み

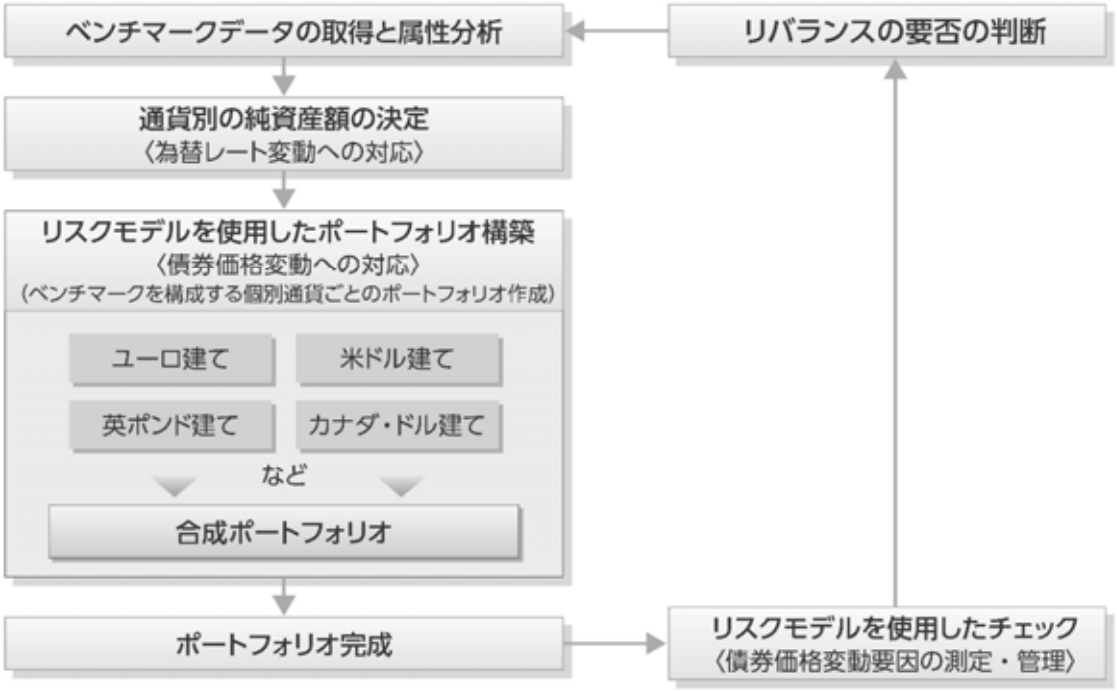
●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



2 海外の債券への投資にあたっては、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

運用プロセス



ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

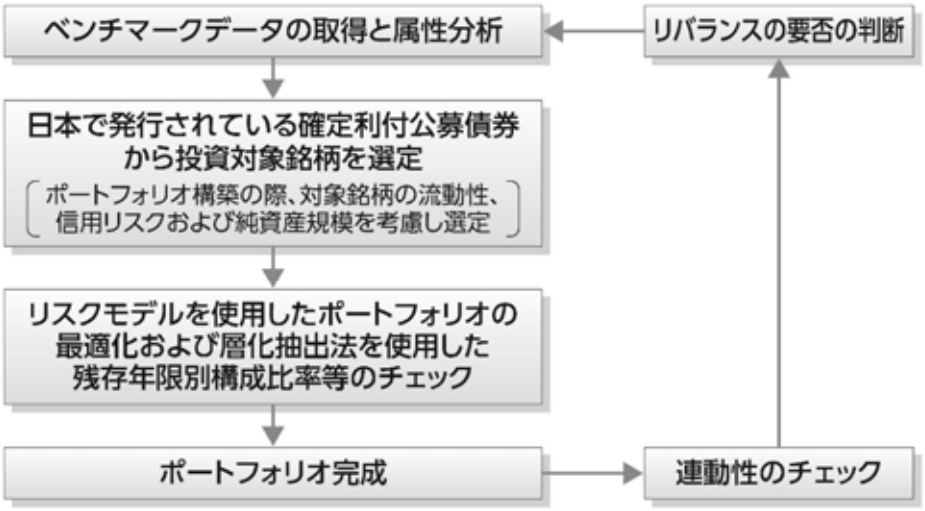
（注）リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響を測定・管理することなどができます。

FTSE世界国債インデックスとは

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

3 わが国の債券への投資にあたっては、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用プロセス



ポートフォリオの構築にあたっては、金利リスクや信用リスクなどのリスク特性がベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数と同程度となるように、リスクモデル(注1)を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法(注2)と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることにより、同指数との連動をめざします。また、ベンチマークの構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

（注1）リスクモデルとは…
債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、ベンチマークに連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

（注2）層化抽出法とは…
ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることをめざす手法です。

・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

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

●海外のリートへの投資にあたっては、組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

投資対象銘柄の業種 (イメージ)

投資対象地域 (イメージ)

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

〈 コーヘン&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

●わが国のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

投資対象銘柄の業種 (イメージ)

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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地域に分散投資します。各地域の時価総額に応じて配分します。

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。

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

〈 アムンディ・アイルランド・リミテッドについて 〉

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

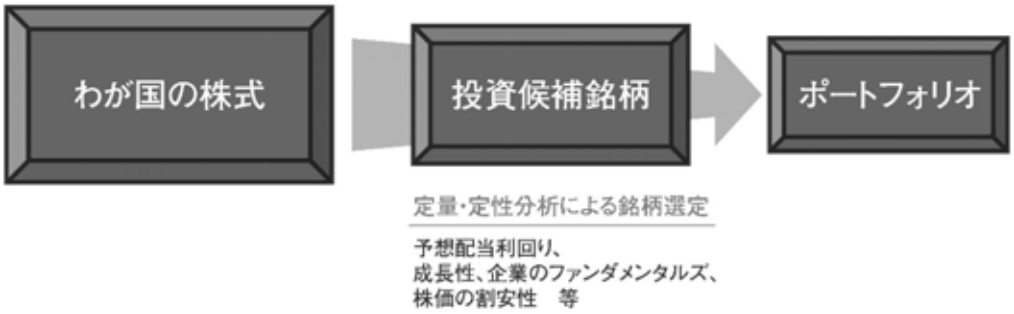
6 わが国の株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。

投資対象のイメージ

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

配当利回り（%）＝（1株当たり年間配当金÷株価）×100

銘柄選定プロセス



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

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

7 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

8 毎年1月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。収益分配金は、自動的に再投資されます。

〈分配方針〉
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への直接投資は、行ないません。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(2)【ファンドの沿革】

2006年1月12日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）	
お取扱窓口	販売会社	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充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	内外の公社債、不動産投資信託証券および株式　など ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。 ・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド（コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）	

（注1）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（2023年7月末日現在）＞
・資本金の額　151億7,427万2,500円
・沿革

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

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
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	2,608,525	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券

8．ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

② 投資態度

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率（信託財産の純資産総額に対する比率とします。）を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

	安　定 コース	６分散 コース	成　長 コース
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券	25%	16.7%	5%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券	15%	16.7%	20%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券	10% （注）	16.7% （注）	25% （注）
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券			
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券	10%	16.7%	25%

（注）3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

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

(2)【投資対象】

＜各ファンド共通＞

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マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

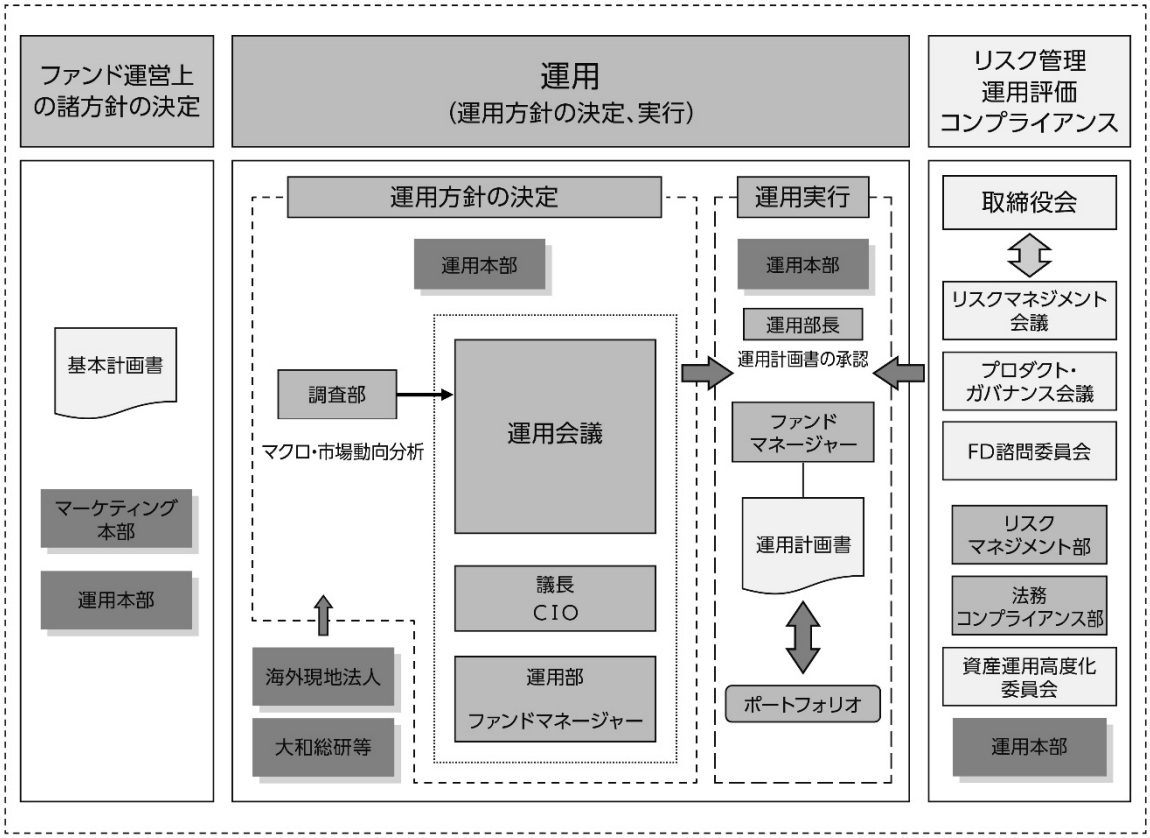
より運用することを指図することができます。

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

(3)【運用体制】

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、プロダクト・ガバナンス会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

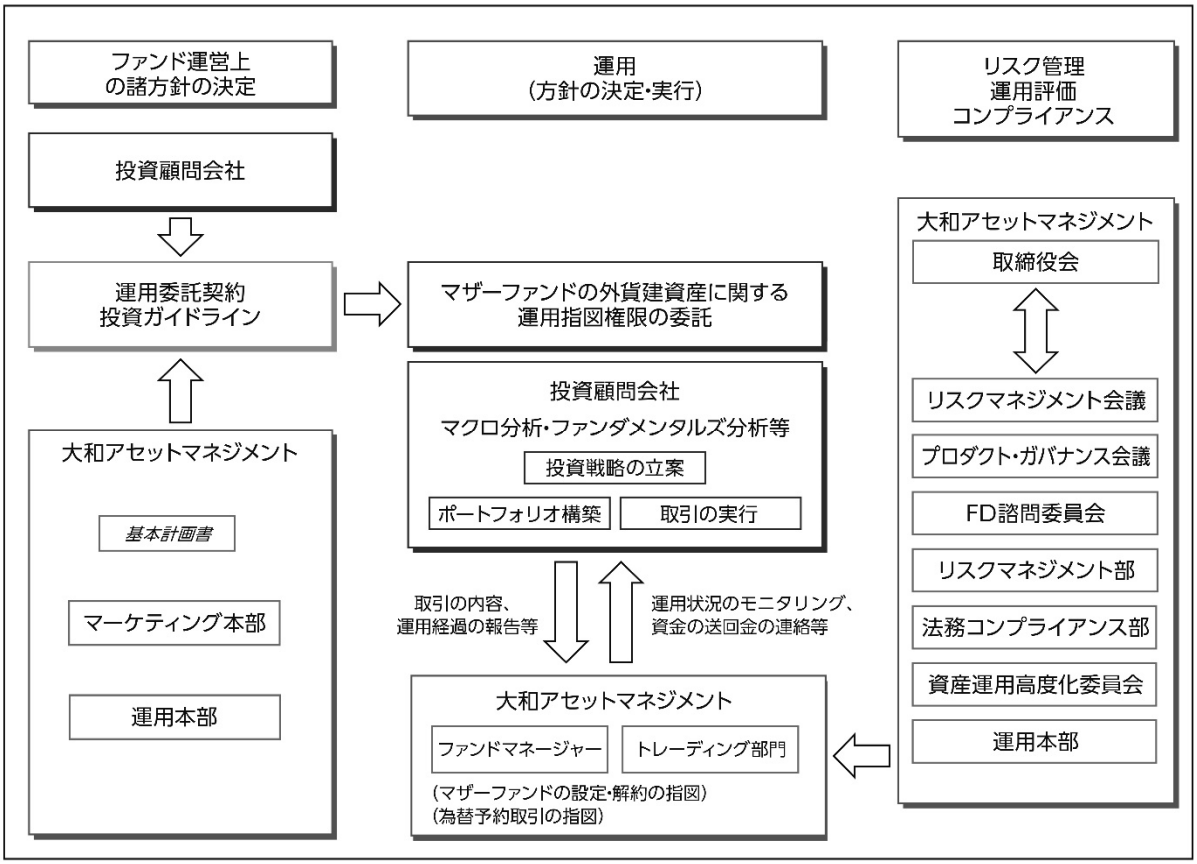
ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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。

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



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

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

（前④に同じ。）

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

(4)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。
③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

① 株式（信託約款）
株式への直接投資は、行ないません。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 資金の借入れ（信託約款）
イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。
ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針
① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．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。

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前 20. の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

① 株式

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

ロ．株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。

② 同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

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

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の

事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

①　主要投資対象

内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ロ．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。

ハ．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生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第 22 条第 1 項第 6 号に掲げるもの
2．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7．コマーシャル・ペーパー
8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前 1. から前 7. までの証券または証書の性質を有するもの
9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
10．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
12．預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
13．外国法人が発行する譲渡性預金証書
14．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16．外国の者に対する権利で前 15. の有価証券の性質を有するもの

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

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式

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

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

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

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が

保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

3．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

託の受益証券に限ります。）
なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

(3) 主な投資制限

①　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割合には、制限を設けません。
③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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。

4．ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

イ．わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。
(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。
(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。
ハ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。
ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、(3) ⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2.（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
3. 投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
4. 新投資口予約権証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前 2. の証券および前 3. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

(3) 主な投資制限

①～②（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。

④ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 先物取引等

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

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

ロ．先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに(2) ③1. から 4. に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

(1) 投資方針

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

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

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

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

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

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

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

(2) 投資対象

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国の者の発行する証券または証書で、前 1. または前 5. の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券
13. 前 12. 以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、前 1. から前 11. までの証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
17. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前 20. の有価証券の性質を有するもの

なお、前 1. の証券または証書、前 12. の証券または証書のうち前 1. の証券または証書の性質を有するもの、および前 13. ならびに前 17. の証券または証書のうち前 1. の証券または証

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

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞
＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

①（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

②　委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

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

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

③　（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

＜各ファンド共通＞

①　株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

③　先物取引等

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

商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

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

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

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

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

④　スワップ取引

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

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超え

ないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

(4) 運用指図権限の委託

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

①（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

②（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

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・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

該当事項はありません。

8．ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

ます。

② 投資態度

イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。

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

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

ニ．J-REIT（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1．株券または新株引受権証書

2.～10.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12.～20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

③ （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

③ 先物取引等

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

けるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

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

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

④　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の

事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

３【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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 ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

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

③ 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。

④ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。
・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

⑤　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。

⑥　その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。

ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

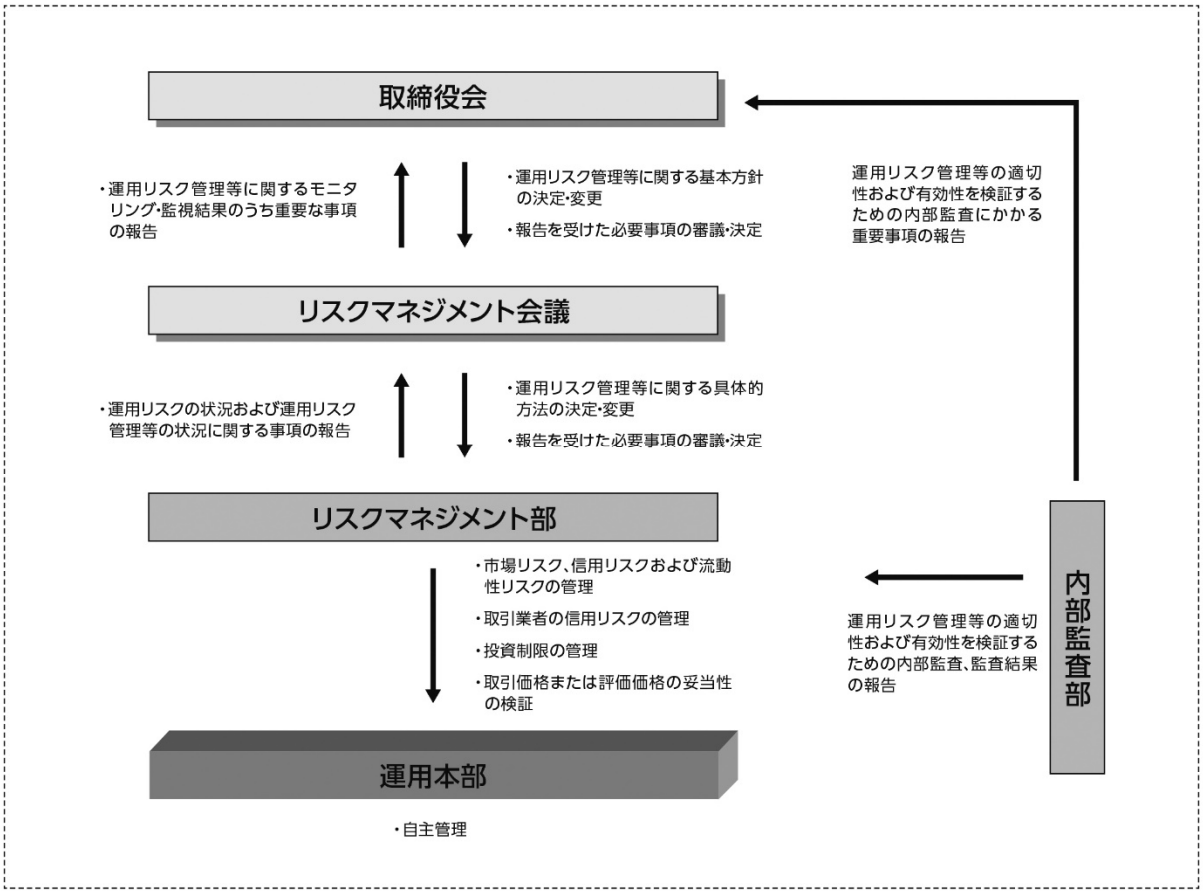
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

・　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。

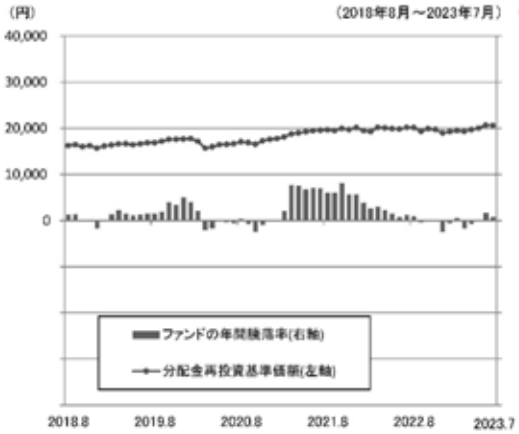
参考情報

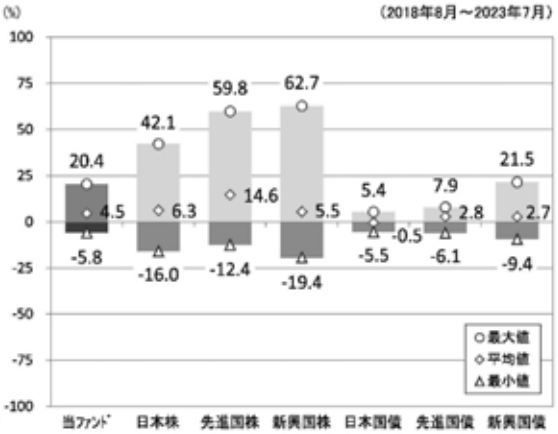
●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

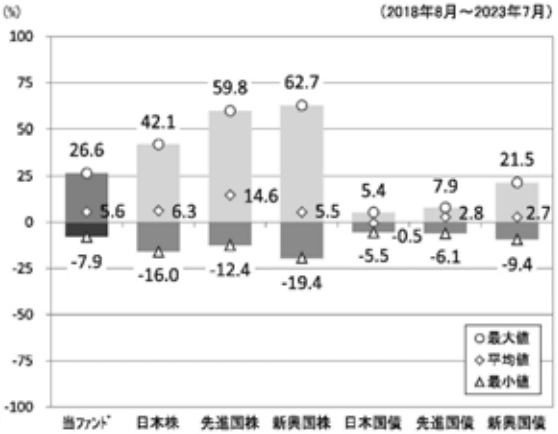
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）]

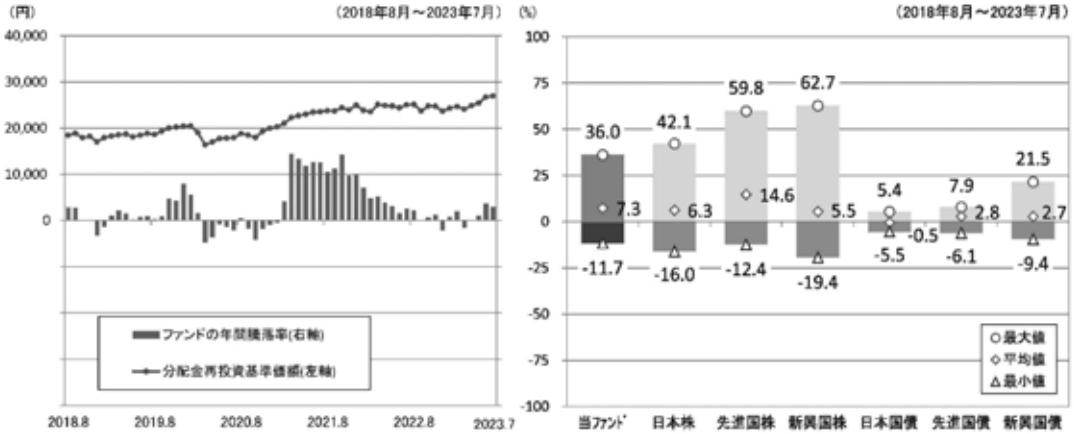




[DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）]



[DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

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。

(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次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 か月終了日（6 か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

安定コース	年率 0.99%（税抜 0.9%）
６分散コース	年率 1.155%（税抜 1.05%）
成長コース	年率 1.32%（税抜 1.2%）

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、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社	受託会社
安定コース	年率 0.45%（税抜）	年率 0.4%（税抜）	年率 0.05%（税抜）
６分散コース	年率 0.53%（税抜）	年率 0.47%（税抜）	
成長コース	年率 0.61%（税抜）	年率 0.54%（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・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

イ．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

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

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

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。
委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。
受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。
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。

＜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、2023 年 7 月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金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】

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

(1) 【投資状況】 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		9,095,126,430	99.11
	内 日本	9,095,126,430	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		81,848,903	0.89
純資産総額		9,176,975,333	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】 (2023 年 7 月 31 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	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	690,445,742	3.0566 2,110,453,729	3.2788 2,263,833,498	24.67
2	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,798,487,505	1.2216 2,197,124,789	1.2345 2,220,232,824	24.19
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	368,661,116	3.4022 1,254,270,568	3.7510 1,382,847,846	15.07
4	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	390,165,805	3.3353 1,301,329,737	3.4956 1,363,863,587	14.86
5	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	209,039,718	3.5586 743,903,752	4.4798 936,456,128	10.20
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	135,966,300	4.4104 599,668,534	5.2665 716,066,518	7.80
7	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	67,150,056	2.2855 153,477,691	2.6808 180,015,870	1.96
8	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	9,478,876	2.9587 28,045,544	3.3559 31,810,159	0.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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8計算期間末 (2014年1月10日)	1,780,966,415	1,780,966,415	1.3008	1.3008
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,254,707,121	2,254,707,121	1.5471	1.5471
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,390,744,550	2,390,744,550	1.4830	1.4830
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715
第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
第15計算期間末 (2021年1月12日)	5,838,750,574	5,838,750,574	1.7702	1.7702
第16計算期間末 (2022年1月11日)	7,477,305,392	7,477,305,392	1.9976	1.9976
2022年7月末日	8,028,628,290	－	2.0200	－
8月末日	8,108,842,660	－	2.0147	－
9月末日	7,901,114,488	－	1.9367	－
10月末日	8,192,415,627	－	1.9943	－
11月末日	8,185,068,378	－	1.9750	－
12月末日	7,960,638,236	－	1.8999	－
第17計算期間末 (2023年1月10日)	7,978,470,707	7,978,470,707	1.9057	1.9057
2023年1月末日	8,133,149,444	－	1.9290	－
2月末日	8,326,275,373	－	1.9539	－
3月末日	8,375,640,511	－	1.9329	－
4月末日	8,582,994,582	－	1.9717	－
5月末日	8,790,090,037	－	2.0033	－
6月末日	9,182,444,675	－	2.0693	－
7月末日	9,176,975,333	－	2.0616	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第 10 計算期間	0.0000
第 11 計算期間	0.0000
第 12 計算期間	0.0000
第 13 計算期間	0.0000
第 14 計算期間	0.0000
第 15 計算期間	0.0000
第 16 計算期間	0.0000
第 17 計算期間	0.0000
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 8 計算期間	23.6
第 9 計算期間	18.9
第 10 計算期間	△4.1
第 11 計算期間	4.9
第 12 計算期間	5.4
第 13 計算期間	△4.2
第 14 計算期間	12.2
第 15 計算期間	0.4
第 16 計算期間	12.8
第 17 計算期間	△4.6
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	7.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8 計算期間	351,397,372	213,512,755
第 9 計算期間	438,028,259	349,751,949
第 10 計算期間	345,342,005	190,621,495
第 11 計算期間	389,459,803	224,474,896
第 12 計算期間	458,208,043	289,727,307
第 13 計算期間	575,990,631	232,603,369
第 14 計算期間	809,239,523	304,172,889
第 15 計算期間	963,521,848	459,114,213
第 16 計算期間	842,864,166	398,104,027
第 17 計算期間	810,744,400	367,320,010
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	440,309,926	199,205,251

（参考）マザーファンド
外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023 年 7 月 31 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		257,329,996,071	97.48
	内 ユーロ	87,332,551,993	33.08
	内 中国	13,984,522,048	5.30
	内 シンガポール	1,056,996,397	0.40
	内 マレーシア	1,319,698,367	0.50
	内 イスラエル	669,881,299	0.25
	内 ノルウェー	412,584,872	0.16
	内 スウェーデン	507,707,066	0.19
	内 デンマーク	787,730,140	0.30
	内 イギリス	12,501,719,367	4.74
	内 ポーランド	1,274,372,693	0.48
	内 カナダ	4,776,325,263	1.81
	内 アメリカ	125,889,793,036	47.69
	内 メキシコ	2,453,481,318	0.93
	内 オーストラリア	3,871,876,001	1.47
	内 ニュージーランド	490,756,211	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,641,977,367	2.52
純資産総額		263,971,973,438	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）		1,750,661,104	0.66
	内 日本	1,750,661,104	0.66
為替予約取引（売建）		18,593,760	△0.01
	内 日本	18,593,760	△0.01

（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（2023 年 7 月 31 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	9,700,000	102.59 1,402,961,297	101.07 1,382,149,669	4.125000 2032/11/15	0.52
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,252,522,961	84.87 1,244,342,190	1.875000 2032/02/15	0.47
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,240,098,711	81.74 1,232,979,162	1.125000 2031/02/15	0.47
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	92.61 1,240,285,778	90.72 1,215,016,200	2.750000 2032/08/15	0.46
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,219,039,766	91.81 1,203,674,600	2.875000 2032/05/15	0.46
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,185,637,770	81.40 1,181,949,713	1.250000 2031/08/15	0.45
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	81.92 1,154,950,513	81.76 1,152,697,593	1.375000 2031/11/15	0.44
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,114,861,526	80.50 1,112,209,035	0.875000 2030/11/15	0.42
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.67 1,112,856,640	96.29 1,085,987,769	3.500000 2033/02/15	0.41
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 1,040,167,444	84.37 1,034,758,848	1.625000 2031/05/15	0.39
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 1,001,063,299	92.36 1,006,413,025	1.625000 2026/05/15	0.38
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.85 981,774,992	94.63 1,000,583,914	0.375000 2024/09/15	0.38
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 941,775,869	99.44 911,323,576	2.750000 2027/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 894,313,680	79.25 893,749,800	0.625000 2030/08/15	0.34
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 881,163,998	90.04 888,525,451	1.125000 2026/10/31	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 892,173,755	94.02 888,065,184	2.875000 2028/08/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 867,301,008	94.20 863,205,125	2.875000 2028/05/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 863,813,128	92.36 859,384,415	2.625000 2029/02/15	0.33
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 839,708,950	85.76 846,320,443	0.750000 2028/01/31	0.32
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	96.29 836,447,333	96.98 842,467,127	2.375000 2024/08/15	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 843,616,215	93.84 840,062,432	2.750000 2028/02/15	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 841,516,467	93.09 839,910,537	2.375000 2027/05/15	0.32

	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 (%)
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 827,744,121	91.54 838,794,760	0.250000 2025/06/30	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 826,672,044	90.66 830,722,113	1.500000 2027/01/31	0.31
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 799,534,853	96.25 803,441,171	2.250000 2024/11/15	0.30
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 789,750,592	92.73 784,345,802	2.750000 2029/05/31	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 777,985,236	94.56 778,545,056	2.250000 2025/11/15	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 773,701,597	95.09 775,880,142	2.125000 2025/05/15	0.29
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	102.23 807,951,590	97.91 773,748,902	2.500000 2030/05/25	0.29
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.92 768,536,365	95.34 771,936,646	2.000000 2025/02/15	0.29

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.48%
合計	97.48%

(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	カナダ・ドル買/円売 2023年8月	買建	103,000	11,014,366	10,946,901	0.00%
		豪ドル買/円売 2023年8月	買建	111,000	10,520,435	10,424,265	0.00%
		米ドル買/円売 2023年8月	買建	3,536,000	495,260,405	498,187,577	0.19%
		オフショア人民元買/円売 2023年8月	買建	41,543,000	823,290,865	818,920,541	0.31%
		ユーロ買/円売 2023年8月	買建	2,205,000	342,442,170	342,411,717	0.13%
		シンガポール・ドル買/円売 2023年8月	買建	351,000	37,355,034	37,153,701	0.01%

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
		ポーランド・ズロチ買/円売 2023年8月	買建	927,000	32,773,065	32,616,402	0.01%
		マレーシア・リンギット売/円買 2023年8月	売建	600,000	18,661,800	18,593,760	△0.01%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2023 年 7 月 31 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		41,143,323,030	84.52
	内　日本	41,143,323,030	84.52
地方債証券		2,879,009,110	5.91
	内　日本	2,879,009,110	5.91
特殊債券		1,125,427,700	2.31
	内　日本	1,125,427,700	2.31
社債券		3,129,485,100	6.43
	内　日本	3,129,485,100	6.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		399,142,481	0.82
純資産総額		48,676,387,421	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（2023 年 7 月 31 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	145　5年国債	日本	国債証券	930,000,000	100.33 933,073,800	100.24 932,278,500	0.100000 2025/09/20	1.92
2	147　5年国債	日本	国債証券	720,000,000	100.03 720,244,500	100.01 720,093,600	0.005000 2026/03/20	1.48
3	347　10年国債	日本	国債証券	690,000,000	99.89 689,273,500	100.15 691,069,500	0.100000 2027/06/20	1.42
4	149　5年国債	日本	国債証券	660,000,000	99.96 659,790,100	99.95 659,683,200	0.005000 2026/09/20	1.36
5	144　5年国債	日本	国債証券	650,000,000	100.29 651,932,100	100.23 651,527,500	0.100000 2025/06/20	1.34
6	143　5年国債	日本	国債証券	630,000,000	100.26 631,671,200	100.21 631,335,600	0.100000 2025/03/20	1.30
7	141　5年国債	日本	国債証券	620,000,000	100.24 621,506,600	100.21 621,339,200	0.100000 2024/09/20	1.28
8	337　10年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.65 553,578,500	100.49 552,744,500	0.300000 2024/12/20	1.14
9	369　10年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.53 552,953,600	99.50 547,299,500	0.500000 2032/12/20	1.12

	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 (%)
10	353　10年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.56 517,736,800	99.36 516,677,200	0.100000 2028/12/20	1.06
11	148　5年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.97 499,882,100	99.98 499,925,000	0.005000 2026/06/20	1.03
12	349　10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.80 499,026,400	99.95 499,780,000	0.100000 2027/12/20	1.03
13	352　10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.74 498,705,000	99.49 497,455,000	0.100000 2028/09/20	1.02
14	358　10年国債	日本	国債証券	480,000,000	99.06 475,516,800	98.50 472,833,600	0.100000 2030/03/20	0.97
15	361　10年国債	日本	国債証券	480,000,000	98.54 473,026,200	97.77 469,329,600	0.100000 2030/12/20	0.96
16	362　10年国債	日本	国債証券	480,000,000	98.48 472,723,800	97.52 468,120,000	0.100000 2031/03/20	0.96
17	360　10年国債	日本	国債証券	460,000,000	98.73 454,194,800	97.98 450,735,600	0.100000 2030/09/20	0.93
18	151　5年国債	日本	国債証券	450,000,000	99.72 448,744,500	99.85 449,343,000	0.005000 2027/03/20	0.92
19	154　5年国債	日本	国債証券	440,000,000	99.95 439,788,800	100.08 440,360,800	0.100000 2027/09/20	0.90
20	348　10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.95 429,793,600	100.08 430,352,600	0.100000 2027/09/20	0.88
21	357　10年国債	日本	国債証券	420,000,000	99.30 417,063,000	98.68 414,472,800	0.100000 2029/12/20	0.85
22	345　10年国債	日本	国債証券	410,000,000	100.20 410,828,200	100.23 410,967,600	0.100000 2026/12/20	0.84
23	146　5年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.33 401,320,600	100.26 401,048,000	0.100000 2025/12/20	0.82
24	350　10年国債	日本	国債証券	400,000,000	99.85 399,422,900	99.81 399,260,000	0.100000 2028/03/20	0.82
25	364　10年国債	日本	国債証券	400,000,000	98.12 392,481,900	97.06 388,248,000	0.100000 2031/09/20	0.80
26	368　10年国債	日本	国債証券	400,000,000	99.52 398,084,000	96.99 387,988,000	0.200000 2032/09/20	0.80
27	363　10年国債	日本	国債証券	380,000,000	98.41 373,973,200	97.29 369,728,600	0.100000 2031/06/20	0.76
28	370　10年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.94 353,315,600	99.27 347,445,000	0.500000 2033/03/20	0.71
29	150　5年国債	日本	国債証券	330,000,000	99.82 329,412,700	99.91 329,719,500	0.005000 2026/12/20	0.68
30	142　5年国債	日本	国債証券	320,000,000	100.25 320,819,200	100.22 320,707,200	0.100000 2024/12/20	0.66

(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	84.52%
地方債証券	5.91%
特殊債券	2.31%
社債券	6.43%
合計	99.18%

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

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・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資状況（2023 年 7 月 31 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		91,356,056,948	98.90
	内 香港	2,995,873,849	3.24
	内 シンガポール	7,744,758,968	8.38
	内 イギリス	9,647,735,021	10.44
	内 オランダ	710,382,398	0.77
	内 ベルギー	3,100,241,082	3.36
	内 フランス	3,214,566,696	3.48
	内 スペイン	1,146,858,285	1.24
	内 カナダ	2,498,361,130	2.70
	内 アメリカ	44,956,472,403	48.67
	内 オーストラリア	14,396,509,627	15.59
	内 ニュージーランド	944,297,489	1.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,014,708,552	1.10
純資産総額		92,370,765,500	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）		3,155,462	0.00
	内 日本	3,155,462	0.00
為替予約取引（売建）		3,153,218	△0.00
	内 日本	3,153,218	△0.00

（注 1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注 2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
（注 3）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2023 年 7 月 31 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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,467,182	1,802.43 4,447,063,851	1,926.18 4,752,236,625	5.14
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	238,359	16,892.43 4,026,463,938	17,430.94 4,154,821,547	4.50

	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 (%)
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	213,319	15,688.12 3,346,604,220	17,547.94 3,743,310,207	4.05
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	308,171	10,087.81 3,108,771,482	11,419.97 3,519,306,564	3.81
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	197,114	14,657.91 2,889,294,776	17,308.29 3,411,707,576	3.69
6	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	668,615	4,406.72 2,946,400,564	5,000.20 3,343,212,668	3.62
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	365,942	8,912.12 3,261,320,261	8,665.42 3,171,043,285	3.43
8	LINK REIT	香港	投資証券	3,757,392	872.36 3,277,806,607	797.32 2,995,873,849	3.24
9	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	5,432,577	416.08 2,260,428,664	410.89 2,232,202,429	2.42
10	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	101,060	21,320.58 2,154,668,697	20,967.87 2,119,013,730	2.29
11	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,545,018	1,420.42 2,194,764,004	1,366.61 2,111,437,666	2.29
12	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	18,775	97,476.52 1,830,121,774	112,403.83 2,110,382,081	2.28
13	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,806,604	1,131.56 2,044,414,290	1,072.08 1,936,830,520	2.10
14	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,509,803	362.77 1,636,290,281	395.57 1,783,949,988	1.93
15	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	836,030	2,246.32 1,878,067,833	2,122.54 1,774,512,467	1.92
16	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	94,871	19,228.02 1,824,185,523	18,537.55 1,758,676,380	1.90
17	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	85,535	21,787.90 1,863,636,076	19,854.21 1,698,230,263	1.84
18	UNITE GROUP PLC/THE	イギリス	投資証券	950,797	1,658.70 1,577,170,734	1,742.23 1,656,514,663	1.79
19	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,418,966	1,150.62 1,632,728,577	1,164.02 1,651,717,289	1.79
20	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	103,022	15,250.13 1,571,099,367	15,296.65 1,575,891,961	1.71
21	AMERICOLD REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	346,534	4,099.40 1,420,584,113	4,508.22 1,562,251,717	1.69
22	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	アメリカ	投資証券	549,697	2,713.67 1,491,697,632	2,761.60 1,518,044,500	1.64
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	517,958	2,680.96 1,388,654,085	2,844.77 1,473,473,762	1.60
24	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	3,858,959	346.71 1,338,044,775	380.53 1,468,480,540	1.59

	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 (%)
25	DEXUS/AU	オーストラリア	投資証券	1,759,183	754.49 1,327,354,541	768.59 1,352,095,388	1.46
26	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	6,113,800	213.28 1,304,398,998	217.09 1,327,275,411	1.44
27	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	シンガポール	投資証券	9,746,300	132.05 1,287,571,632	133.43 1,300,487,794	1.41
28	FRASERS CENTREPOINT TRUST	シンガポール	投資証券	5,594,100	233.08 1,304,184,426	230.86 1,291,465,114	1.40
29	KLEPIERRE	フランス	投資証券	342,991	3,611.26 1,238,638,243	3,734.61 1,280,938,990	1.39
30	UDR INC	アメリカ	投資証券	222,825	5,729.58 1,276,700,789	5,672.63 1,264,004,404	1.37

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.90%
合計	98.90%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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	米ドル買/円売 2023年8月	買建	22,387	3,153,695	3,155,462	0.00%
		英ポンド売/円買 2023年8月	売建	17,405	3,153,695	3,153,218	△0.00%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		156,425,227,200	96.81
	内 日本	156,425,227,200	96.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,153,962,411	3.19
純資産総額		161,579,189,611	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)		3,348,642,000	2.07
	内 日本	3,348,642,000	2.07

(注 1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注 2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
(注 3) 不動産投信指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産 (2023 年 7 月 31 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	日本ビルファンド	日本	投資証券	21,975	552,493.23 12,141,038,734	596,000.00 13,097,100,000	8.11
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	36,269	307,323.40 11,146,312,403	290,700.00 10,543,398,300	6.53
3	GLP投資法人	日本	投資証券	71,535	150,243.51 10,747,669,639	140,100.00 10,022,053,500	6.20
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	87,043	98,579.84 8,580,685,179	97,500.00 8,486,692,500	5.25
5	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	28,875	291,384.41 8,413,725,122	280,000.00 8,085,000,000	5.00
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	41,291	159,822.87 6,599,246,206	169,200.00 6,986,437,200	4.32
7	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,875	654,148.90 6,459,720,475	674,000.00 6,655,750,000	4.12
8	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	36,690	148,929.91 5,464,238,772	153,500.00 5,631,915,000	3.49

	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 (%)
9	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	24,891	211,031.40 5,252,782,802	222,500.00 5,538,247,500	3.43
10	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	15,148	347,502.72 5,263,971,263	354,000.00 5,362,392,000	3.32
11	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	14,716	350,742.29 5,161,523,562	346,500.00 5,099,094,000	3.16
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	71,816	75,728.21 5,438,497,135	70,600.00 5,070,209,600	3.14
13	三菱地所物流 REIT	日本	投資証券	12,422	420,120.28 5,218,734,175	407,000.00 5,055,754,000	3.13
14	オリックス不動産投資	日本	投資証券	27,315	177,080.41 4,836,951,535	180,900.00 4,941,283,500	3.06
15	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	15,982	248,600.35 3,973,130,880	278,300.00 4,447,790,600	2.75
16	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	7,769	538,173.37 4,181,068,971	572,000.00 4,443,868,000	2.75
17	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	27,607	160,791.67 4,438,975,750	152,100.00 4,199,024,700	2.60
18	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	10,188	340,005.30 3,463,974,073	340,500.00 3,469,014,000	2.15
19	イオンリート投資	日本	投資証券	22,688	155,512.98 3,528,278,696	149,700.00 3,396,393,600	2.10
20	産業ファンド	日本	投資証券	18,564	153,611.28 2,851,639,982	148,800.00 2,762,323,200	1.71
21	日本リート投資法人	日本	投資証券	7,916	323,913.61 2,564,100,175	338,500.00 2,679,566,000	1.66
22	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	16,111	154,122.62 2,483,069,640	165,000.00 2,658,315,000	1.65
23	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	44,751	57,325.82 2,565,387,964	58,900.00 2,635,833,900	1.63
24	森ヒルズリート	日本	投資証券	16,581	149,539.22 2,479,509,828	144,700.00 2,399,270,700	1.48
25	API投資法人	日本	投資証券	5,456	394,500.00 2,152,392,000	414,000.00 2,258,784,000	1.40
26	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	26,599	78,262.61 2,081,707,412	84,400.00 2,244,955,600	1.39
27	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4,422	482,948.28 2,135,597,295	472,500.00 2,089,395,000	1.29
28	三井不ロジパーク	日本	投資証券	3,854	519,853.85 2,003,516,748	506,000.00 1,950,124,000	1.21
29	NTT 都市開発リート投資法人	日本	投資証券	14,238	130,296.96 1,855,168,186	134,900.00 1,920,706,200	1.19
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,990	588,717.36 1,760,264,931	626,000.00 1,871,740,000	1.16

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.81%
合計	96.81%

（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
不動産投信指数先物取引	日本	ＴＲＥＩＴ先物　０５０９月	買建	1,796	3,316,080,060	3,348,642,000	2.07%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		4,069,844,770	75.83
	内 カナダ	56,745,728	1.06
	内 アメリカ	4,013,099,042	74.78
ハイブリッド優先証券		937,291,691	17.46
	内 アメリカ	937,291,691	17.46
投資証券		60,270,952	1.12
	内 アメリカ	60,270,952	1.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		299,455,503	5.58
純資産総額		5,366,862,916	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 (2023 年 7 月 31 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	23,289.65 256,232,770	27,606.15 303,722,918	5.66
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	6,173	40,337.15 249,001,263	47,700.01 294,452,217	5.49
3	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,541	87,336.55 134,585,629	126,843.39 195,465,674	3.64
4	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,279	31,223.44 102,381,677	45,882.91 150,450,080	2.80
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	7,130	15,347.40 109,426,990	18,689.80 133,258,293	2.48
6	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	6,283	14,450.83 90,794,594	18,637.64 117,100,315	2.18
7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,553	37,720.75 58,580,329	65,903.47 102,348,097	1.91
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	5,477	14,961.99 81,947,209	14,683.43 80,421,175	1.50

	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	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,872	40,737.51 76,260,620	41,449.40 77,593,294	1.45
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,056	23,378.46 71,444,588	24,596.44 75,166,738	1.40
11	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,521	22,811.76 57,508,461	28,659.20 72,249,846	1.35
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	3,213	21,400.09 68,758,828	22,049.11 70,843,815	1.32
13	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	3,077	19,556.76 60,176,175	22,119.60 68,062,018	1.27
14	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	13,482	4,962.00 66,899,343	4,797.20 64,675,973	1.21
15	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	14,012	4,161.43 58,310,019	4,496.94 63,011,165	1.17
16	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	843	53,481.19 45,084,650	74,554.80 62,849,700	1.17
17	KLA CORP	アメリカ	株式	情報技術	859	52,869.38 45,414,805	72,037.07 61,879,851	1.15
18	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,608	26,079.45 41,935,756	37,560.04 60,396,555	1.13
19	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,194	27,188.88 59,652,411	26,486.85 58,112,156	1.08
20	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,164	47,495.61 55,284,893	49,794.83 57,961,186	1.08
21	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,525	15,155.68 53,423,789	16,229.87 57,210,313	1.07
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	697	69,258.56 48,273,217	79,411.22 55,349,621	1.03
23	CARDINAL HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,181	11,366.41 47,522,965	12,925.53 54,041,680	1.01
24	NIKE INC -CL B	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,406	17,755.17 60,474,114	15,312.16 52,153,222	0.97
25	ELEVANCE HEALTH INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	784	68,294.32 53,542,752	65,838.62 51,617,485	0.96
26	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	1,552	32,989.79 51,200,169	33,233.67 51,578,667	0.96
27	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	924	52,501.45 48,511,346	55,395.57 51,185,508	0.95
28	DEERE & CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	834	54,663.93 45,589,723	60,209.69 50,214,887	0.94
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	626	83,008.77 51,963,493	79,203.99 49,581,701	0.92

	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 (%)
30	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	608	65,273.33 39,686,190	80,288.05 48,815,137	0.91

（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	75.83%
ハイブリッド優先証券	17.46%
投資証券	1.12%
合計	94.42%

（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	3.71%
素材	2.39%
資本財・サービス	6.26%
一般消費財・サービス	7.21%
生活必需品	5.58%
ヘルスケア	9.19%
金融	9.71%
情報技術	22.36%
コミュニケーション・サービス	7.69%
公益事業	1.74%
合計	75.83%

（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 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,647,327,733	96.94
	内 スウェーデン	4,452,447	0.26
	内 イギリス	341,169,353	20.08
	内 オランダ	112,108,561	6.60
	内 フランス	363,780,187	21.41
	内 ドイツ	359,944,831	21.18
	内 スイス	325,690,143	19.17
	内 スペイン	22,170,249	1.30
	内 イタリア	118,011,962	6.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		51,923,790	3.06
純資産総額		1,699,251,523	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 (2023 年 7 月 31 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	5,718	18,302.76 104,655,182	17,392.32 99,449,286	5.85
2	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,784	23,367.74 65,055,808	25,188.44 70,124,642	4.13
3	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,870	22,705.95 65,166,094	23,967.39 68,786,432	4.05
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	21,671	3,451.10 74,788,794	3,092.08 67,008,604	3.94
5	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,498	14,166.90 63,722,716	14,620.50 65,763,009	3.87
6	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	926	68,315.40 63,260,060	69,190.20 64,070,125	3.77
7	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,990	15,851.91 63,249,137	14,752.03 58,860,624	3.46
8	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,346	44,874.00 60,400,404	43,642.80 58,743,209	3.46

	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	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,063	51,809.22 55,073,206	54,263.75 57,682,372	3.39
10	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	6,455	9,122.15 58,883,491	8,457.25 54,591,575	3.21
11	AXA SA	フランス	株式	金融	12,428	4,460.87 55,439,758	4,377.76 54,406,839	3.20
12	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	3,071	16,106.68 49,463,639	17,287.34 53,089,446	3.12
13	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	44,484	1,058.75 47,097,506	1,172.00 52,135,319	3.07
14	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	12,054	4,461.14 53,774,630	4,242.79 51,142,687	3.01
15	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	49,350	886.73 43,760,510	974.82 48,107,429	2.83
16	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,793	26,199.77 46,976,201	25,943.45 46,516,606	2.74
17	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	90,114	498.36 44,909,465	515.60 46,463,377	2.73
18	DHL GROUP	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,108	6,655.97 40,654,669	7,281.25 44,473,902	2.62
19	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	90,643	485.97 44,050,539	473.65 42,933,673	2.53
20	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	103,053	383.40 39,519,152	405.38 41,776,225	2.46
21	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財・サービス	8,835	4,571.95 40,393,183	4,646.51 41,051,991	2.42
22	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,174	34,037.18 39,959,655	34,068.25 39,996,131	2.35
23	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	4,089	9,226.23 37,726,081	9,348.96 38,227,910	2.25
24	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	79	500,256.00 39,520,224	476,766.00 37,664,514	2.22
25	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	4,602	7,809.72 35,940,331	7,652.98 35,219,023	2.07
26	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	18,318	2,026.72 37,125,494	1,869.07 34,237,771	2.01
27	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	オランダ	株式	生活必需品	6,669	4,752.15 31,692,132	4,941.68 32,956,087	1.94
28	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	1,845	17,546.78 32,373,814	17,717.66 32,689,097	1.92
29	GSK	イギリス	株式	ヘルスケア	13,036	2,745.18 35,786,166	2,505.99 32,668,164	1.92

	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 (%)
30	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	15,213	2,118.22 32,224,603	1,995.01 30,350,118	1.79

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	96.94%
合計	96.94%

（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	7.88%
素材	5.84%
資本財・サービス	10.79%
一般消費財・サービス	5.80%
生活必需品	12.39%
ヘルスケア	12.71%
金融	25.12%
情報技術	2.74%
コミュニケーション・サービス	7.52%
公益事業	6.15%
合計	96.94%

（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（2023 年 7 月 31 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		678,509,883	98.15
	内 韓国	142,132,835	20.56
	内 台湾	195,428,872	28.27
	内 香港	79,413,959	11.49
	内 シンガポール	43,397,820	6.28
	内 オーストラリア	218,136,397	31.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,799,855	1.85
純資産総額		691,309,738	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		4,199,000	△0.61
	内 日本	4,199,000	△0.61

（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（2023 年 7 月 31 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	23,000	2,314.82 53,241,035	2,543.61 58,503,230	8.46
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	7,400	7,193.55 53,232,270	7,801.30 57,729,620	8.35
3	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	8,700	4,364.44 37,970,645	4,303.36 37,439,302	5.42
4	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	26,000	366.96 9,541,037	1,186.57 30,850,910	4.46
5	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	21,000	1,528.66 32,101,944	1,409.33 29,596,056	4.28
6	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	2,760	9,312.37 25,702,157	9,912.78 27,359,273	3.96
7	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	870	28,319.54 24,638,003	25,064.76 21,806,350	3.15

	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 (%)
8	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	3,750	4,853.03 18,198,878	4,661.35 17,480,084	2.53
9	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	シンガポール	株式	コミュニケーション・サービス	59,800	264.75 15,832,050	281.69 16,845,301	2.44
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	34,000	468.79 15,939,113	491.22 16,701,750	2.42
11	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	6,000	2,674.10 16,044,610	2,666.58 15,999,509	2.31
12	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	2,700	6,230.36 16,821,994	5,861.53 15,826,147	2.29
13	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	7,000	2,090.61 14,634,270	2,093.42 14,654,002	2.12
14	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	オーストラリア	株式	金融	6,050	2,253.16 13,631,623	2,420.40 14,643,478	2.12
15	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	4,078	3,267.92 13,326,614	3,572.35 14,568,081	2.11
16	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	4,000	3,449.16 13,796,652	3,628.13 14,512,536	2.10
17	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	1,000	9,867.65 9,867,650	14,144.00 14,144,000	2.05
18	ASUSTEK COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	8,000	1,244.89 9,959,142	1,740.60 13,924,854	2.01
19	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	820	16,914.67 13,870,037	16,603.67 13,615,011	1.97
20	ASIA CEMENT CORP	台湾	株式	素材	71,000	195.81 13,903,097	179.89 12,772,375	1.85
21	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	シンガポール	株式	金融	8,600	1,359.75 11,693,902	1,399.99 12,039,983	1.74
22	KT&G CORP	韓国	株式	生活必需品	1,300	9,237.80 12,009,140	9,215.70 11,980,410	1.73
23	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	4,000	3,292.78 13,171,168	2,951.85 11,807,415	1.71
24	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	1,070	11,363.52 12,158,969	10,957.61 11,724,648	1.70
25	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	7,000	1,410.87 9,876,149	1,644.15 11,509,090	1.66
26	LG CORP	韓国	株式	資本財・サービス	1,200	10,177.05 12,212,460	9,248.85 11,098,620	1.61
27	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	52,000	230.13 11,967,120	211.07 10,975,692	1.59
28	SAMSUNG SDS CO LTD	韓国	株式	情報技術	800	13,215.80 10,572,640	13,558.35 10,846,680	1.57

	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 (%)
29	KIA CORP	韓国	株式	一般消費財･サービス	1,150	9,438.52 10,854,309	9,304.10 10,699,715	1.55
30	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	5,500	1,997.84 10,988,120	1,793.53 9,864,448	1.43

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.15%
合計	98.15%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.11%
素材	12.04%
資本財・サービス	2.84%
一般消費財・サービス	4.08%
生活必需品	1.73%
ヘルスケア	3.15%
金融	26.69%
情報技術	38.39%
コミュニケーション・サービス	3.58%
公益事業	2.12%
不動産	1.43%
合計	98.15%

(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

(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	韓国ウォン売/円買 2023年８月	売建	38,000,000	4,198,886	4,199,000	△0.61%

(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 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		24,899,389,050	95.57
	内 日本	24,899,389,050	95.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,154,598,121	4.43
純資産総額		26,053,987,171	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		302,510,000	1.16
	内 日本	302,510,000	1.16

(注 1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注 2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
(注 3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産 (2023 年 7 月 31 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	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	581,500	1,911.67 1,111,641,464	2,386.00 1,387,459,000	5.33
2	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	1,058,100	933.84 988,098,084	1,146.00 1,212,582,600	4.65
3	東京海上HD	日本	株式	保険業	321,200	2,730.75 877,117,947	3,259.00 1,046,790,800	4.02
4	三菱商事	日本	株式	卸売業	132,100	5,516.52 728,733,488	7,265.00 959,706,500	3.68
5	日 立	日本	株式	電気機器	94,900	7,709.12 731,596,091	9,298.00 882,380,200	3.39
6	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	5,385,300	160.23 862,914,285	162.90 877,265,370	3.37
7	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	36,700	16,173.02 593,549,855	21,245.00 779,691,500	2.99
8	小松製作所	日本	株式	機械	149,400	3,330.90 497,636,551	3,964.00 592,221,600	2.27

	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	住友電工	日本	株式	非鉄金属	319,700	1,689.86 540,249,079	1,820.00 581,854,000	2.23
10	上 組	日本	株式	倉庫・運輸関連業	162,100	2,901.76 470,375,743	3,298.00 534,605,800	2.05
11	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	193,900	2,476.21 480,137,613	2,751.00 533,418,900	2.05
12	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	242,900	2,042.98 496,240,367	2,080.50 505,353,450	1.94
13	三菱重工業	日本	株式	機械	74,500	5,689.65 423,879,272	6,731.00 501,459,500	1.92
14	九州旅客鉄道	日本	株式	陸運業	151,700	3,005.08 455,871,857	3,117.00 472,848,900	1.81
15	富士フイルム HLDGS	日本	株式	化学	55,900	7,137.82 399,004,650	8,247.00 461,007,300	1.77
16	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	236,600	1,591.06 376,446,634	1,842.00 435,817,200	1.67
17	Ｔ Ｄ Ｋ	日本	株式	電気機器	79,500	4,789.69 380,780,854	5,437.00 432,241,500	1.66
18	三井住友トラスト HD	日本	株式	銀行業	76,300	4,845.95 369,746,133	5,527.00 421,710,100	1.62
19	富士電機	日本	株式	電気機器	64,400	5,348.46 344,441,206	6,418.00 413,319,200	1.59
20	アサヒグループホールディン	日本	株式	食料品	68,600	5,021.88 344,501,188	5,595.00 383,817,000	1.47
21	大日本印刷	日本	株式	その他製品	93,100	4,002.60 372,642,590	4,039.00 376,030,900	1.44
22	MS＆AD	日本	株式	保険業	69,400	4,458.78 309,439,816	5,292.00 367,264,800	1.41
23	デンソー	日本	株式	輸送用機器	35,200	7,807.96 274,840,513	9,881.00 347,811,200	1.33
24	トヨタ紡織	日本	株式	輸送用機器	133,500	2,173.76 290,197,786	2,589.00 345,631,500	1.33
25	KDDI	日本	株式	情報・通信業	78,100	4,119.33 321,720,184	4,187.00 327,004,700	1.26
26	九電工	日本	株式	建設業	76,800	3,641.03 279,631,232	4,099.00 314,803,200	1.21
27	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	45,800	5,648.98 258,723,544	6,694.00 306,585,200	1.18
28	光通信	日本	株式	情報・通信業	14,200	18,668.76 265,096,481	21,070.00 299,194,000	1.15
29	パルグループ HLDGS	日本	株式	小売業	69,300	3,367.47 233,365,902	4,170.00 288,981,000	1.11
30	丸井グループ	日本	株式	小売業	109,200	2,188.34 238,967,077	2,545.00 277,914,000	1.07

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.57%
合計	95.57%

（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
鉱業	0.90%
建設業	4.00%
食料品	2.65%
繊維製品	0.64%
化学	8.64%
医薬品	1.94%
ガラス・土石製品	0.20%
鉄鋼	1.69%
非鉄金属	4.40%
金属製品	0.44%
機械	6.30%
電気機器	10.68%
輸送用機器	10.66%
その他製品	1.44%
電気・ガス業	1.55%
陸運業	3.07%
倉庫・運輸関連業	2.05%
情報・通信業	6.99%
卸売業	8.14%
小売業	2.18%
銀行業	8.31%
証券、商品先物取引業	0.11%
保険業	5.43%
その他金融業	0.53%
不動産業	2.20%
サービス業	0.42%
合計	95.57%

（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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	ＴＯＰＩＸ先物　０５０９月	買建	13	298,192,150	302,510,000	1.16%

（注１）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注２）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

2023年7月31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	20,616円
純資産総額	91億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.4%
3カ月間	4.6%
6カ月間	6.9%
1年間	2.1%
3年間	23.7%
5年間	26.8%
設定来	106.2%

※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：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第6期 12年1月	第7期 13年1月	第8期 14年1月	第9期 15年1月	第10期 16年1月	第11期 17年1月	第12期 18年1月	第13期 19年1月	第14期 20年1月	第15期 21年1月	第16期 22年1月	第17期 23年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	962	24.0%
国内債券	326	24.0%
外国リート	70	15.0%
国内リート・先物	49	14.7%
国内株式・先物	99	9.9%
外国株式	159	8.2%
外国優先出資証券	61	1.4%
コール・ローン、その他		3.3%
合計	1,726	-

通貨別構成	比率
日本円	50.4%
米ドル	27.1%
ユーロ	10.8%
英ポンド	3.2%
豪ドル	2.8%
オフショア人民元	1.4%
シンガポール・ドル	1.2%
カナダ・ドル	1.0%
香港ドル	0.5%
その他	1.5%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.6
最終利回り(%)	2.2
修正デュレーション	7.8
残存年数	9.2

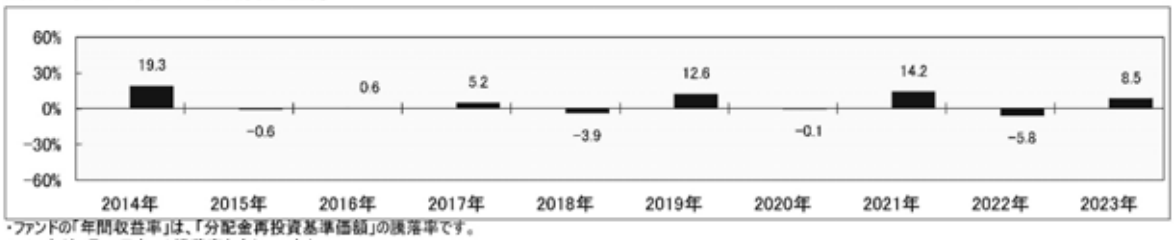
債券格付別構成	比率
AAA	82.1%
AA	9.9%
A	6.5%
BBB	-
BB以下・無格付	1.4%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	0.5%
	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
	APPLE INC	アメリカ	0.4%
	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.4%
	東京海上HD	日本	0.4%
リート	日本ビルファンド	日本	1.2%
	日本プロロジスリート	日本	1.0%
	GLP投資法人	日本	0.9%
	日本都市ファンド投資法人	日本	0.8%
	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.8%
	合計		7.0%

※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。無格付債券を1.4%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は7月31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。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）】

(1) 【投資状況】 (2023 年 7 月 31 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		10,789,041,250	99.11
	内 日本	10,789,041,250	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		96,634,952	0.89
純資産総額		10,885,676,202	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】 (2023 年 7 月 31 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	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	411,122,870	3.5552 1,461,659,432	4.4798 1,841,748,233	16.92
2	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	484,554,091	3.4032 1,649,056,034	3.7510 1,817,562,395	16.70
3	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	509,265,698	3.3370 1,699,449,796	3.4956 1,780,189,173	16.35
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	540,419,765	3.0567 1,651,949,265	3.2788 1,771,928,325	16.28
5	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,407,421,893	1.2216 1,719,327,706	1.2345 1,737,462,326	15.96
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	269,323,513	4.4118 1,188,218,572	5.2665 1,418,392,281	13.03
7	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	133,609,207	2.2860 305,443,659	2.6808 358,179,562	3.29
8	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	18,945,426	2.9589 56,058,852	3.3559 63,578,955	0.58

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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8計算期間末 (2014年1月10日)	1,919,665,131	1,919,665,131	1.3193	1.3193
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,724,473,332	2,724,473,332	1.5976	1.5976
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,855,754,201	2,855,754,201	1.5254	1.5254
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
第15計算期間末 (2021年1月12日)	6,484,800,717	6,484,800,717	1.8830	1.8830
第16計算期間末 (2022年1月11日)	8,604,019,799	8,604,019,799	2.1960	2.1960
2022年7月末日	9,445,324,108	－	2.2206	－
8月末日	9,610,457,620	－	2.2206	－
9月末日	9,236,893,380	－	2.1196	－
10月末日	9,623,527,080	－	2.1966	－
11月末日	9,665,323,503	－	2.1820	－
12月末日	9,381,292,576	－	2.0946	－
第17計算期間末 (2023年1月10日)	9,398,811,297	9,398,811,297	2.0999	2.0999
2023年1月末日	9,628,938,358	－	2.1364	－
2月末日	9,824,324,671	－	2.1674	－
3月末日	9,804,699,319	－	2.1330	－
4月末日	10,047,970,137	－	2.1847	－
5月末日	10,317,346,564	－	2.2274	－
6月末日	10,802,270,075	－	2.3177	－
7月末日	10,885,676,202	－	2.3209	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第 10 計算期間	0.0000
第 11 計算期間	0.0000
第 12 計算期間	0.0000
第 13 計算期間	0.0000
第 14 計算期間	0.0000
第 15 計算期間	0.0000
第 16 計算期間	0.0000
第 17 計算期間	0.0000
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 8 計算期間	29.4
第 9 計算期間	21.1
第 10 計算期間	△4.5
第 11 計算期間	6.7
第 12 計算期間	7.9
第 13 計算期間	△6.2
第 14 計算期間	14.7
第 15 計算期間	△0.3
第 16 計算期間	16.6
第 17 計算期間	△4.4
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	8.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8 計算期間	518,832,342	312,242,524
第 9 計算期間	501,213,562	250,896,906
第 10 計算期間	501,645,807	334,815,579
第 11 計算期間	489,108,988	304,974,316
第 12 計算期間	577,484,738	415,195,786
第 13 計算期間	682,462,389	295,483,585
第 14 計算期間	853,612,726	397,196,903
第 15 計算期間	998,812,762	616,961,375
第 16 計算期間	906,065,649	431,848,512
第 17 計算期間	926,048,289	368,363,492
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	435,742,296	247,233,993

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

2023年7月31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	23,209円
純資産総額	108億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.1%
3カ月間	6.2%
6カ月間	8.6%
1年間	4.5%
3年間	34.3%
5年間	34.1%
設定来	132.1%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第 6 期 12年1月	第 7 期 13年1月	第 8 期 14年1月	第 9 期 15年1月	第 10 期 16年1月	第 11 期 17年1月	第 12 期 18年1月	第 13 期 19年1月	第 14 期 20年1月	第 15 期 21年1月	第 16 期 22年1月	第 17 期 23年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート	70	16.7%
国内株式・先物	99	16.4%
国内リート・先物	49	16.2%
外国債券	962	15.9%
国内債券	326	15.8%
外国株式	159	13.6%
外国優先出資証券	61	2.3%
コール・ローン、その他		3.7%
合計	1,726	－

通貨別構成	比率
日本円	50.4%
米ドル	28.9%
ユーロ	8.9%
英ポンド	3.2%
豪ドル	3.1%
シンガポール・ドル	1.3%
オフショア人民元	0.9%
カナダ・ドル	0.9%
スイス・フラン	0.6%
その他	1.6%
合計	100.0%

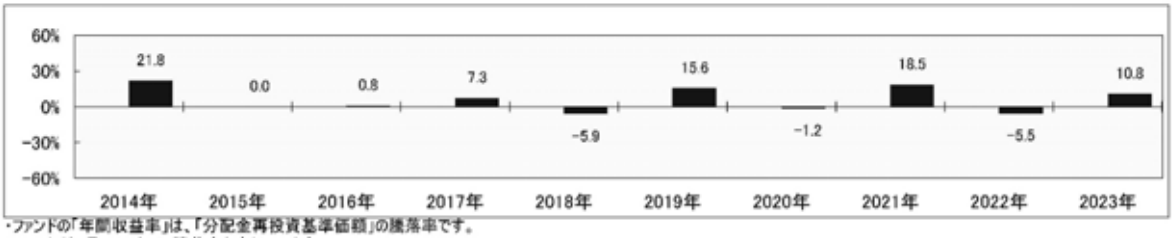
債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.6
最終利回り(%)	2.2
修正デュレーション	7.8
残存年数	9.2
債券格付別構成	**比率**
AAA	82.1%
AA	9.9%
A	6.5%
BBB	－
BB以下・無格付	1.4%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	0.9%
	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%
	APPLE INC	アメリカ	0.7%
	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%
	東京海上HD	日本	0.7%
リート	日本ビルファンド	日本	1.3%
	日本プロロジスリート	日本	1.1%
	GLP投資法人	日本	1.0%
	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.9%
	日本都市ファンド投資法人	日本	0.9%
合計			8.9%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.4%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は7月31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。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(1) 【投資状況】（2023 年 7 月 31 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		14,270,720,703	99.12
	内 日本	14,270,720,703	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		127,050,570	0.88
純資産総額		14,397,771,273	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】（2023 年 7 月 31 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	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	809,866,237	3.5634 2,885,917,968	4.4798 3,628,038,768	25.20
2	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	758,926,420	3.4055 2,584,525,412	3.7510 2,846,733,001	19.77
3	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	805,484,512	3.3405 2,690,756,030	3.4956 2,815,651,660	19.56
4	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	525,511,516	4.4151 2,320,210,035	5.2665 2,767,606,399	19.22
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	214,603,816	3.0610 656,921,722	3.2788 703,642,991	4.89
6	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	258,857,612	2.2906 592,957,915	2.6808 693,945,486	4.82
7	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	561,367,501	1.2224 686,246,095	1.2345 693,008,179	4.81
8	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	36,381,960	2.9603 107,702,564	3.3559 122,094,219	0.85

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

(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8計算期間末 (2014年1月10日)	1,528,562,866	1,528,562,866	1.3144	1.3144
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,263,159,704	2,263,159,704	1.6365	1.6365
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,808,604,084	2,808,604,084	1.5507	1.5507
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
第15計算期間末 (2021年1月12日)	7,237,633,493	7,237,633,493	2.0216	2.0216
第16計算期間末 (2022年1月11日)	10,544,787,720	10,544,787,720	2.4728	2.4728
2022年7月末日	11,949,564,587	－	2.5036	－
8月末日	12,193,613,666	－	2.5121	－
9月末日	11,653,011,981	－	2.3718	－
10月末日	12,262,964,539	－	2.4794	－
11月末日	12,397,709,914	－	2.4734	－
12月末日	12,022,734,330	－	2.3674	－
第17計算期間末 (2023年1月10日)	12,038,049,728	12,038,049,728	2.3715	2.3715
2023年1月末日	12,422,668,106	－	2.4298	－
2月末日	12,675,518,343	－	2.4699	－
3月末日	12,566,430,980	－	2.4113	－
4月末日	12,943,714,100	－	2.4848	－
5月末日	13,451,708,199	－	2.5441	－
6月末日	14,228,815,778	－	2.6707	－
7月末日	14,397,771,273	－	2.6934	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第 10 計算期間	0.0000
第 11 計算期間	0.0000
第 12 計算期間	0.0000
第 13 計算期間	0.0000
第 14 計算期間	0.0000
第 15 計算期間	0.0000
第 16 計算期間	0.0000
第 17 計算期間	0.0000
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 8 計算期間	37.2
第 9 計算期間	24.5
第 10 計算期間	△5.2
第 11 計算期間	9.2
第 12 計算期間	11.1
第 13 計算期間	△8.5
第 14 計算期間	18.5
第 15 計算期間	△0.8
第 16 計算期間	22.3
第 17 計算期間	△4.1
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	11.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8 計算期間	359,002,036	237,170,149
第 9 計算期間	458,619,078	238,638,593
第 10 計算期間	698,613,794	270,347,551
第 11 計算期間	433,420,891	252,225,036
第 12 計算期間	541,348,837	363,638,097
第 13 計算期間	676,061,653	274,586,229
第 14 計算期間	898,116,398	365,651,278
第 15 計算期間	1,060,242,411	584,120,737
第 16 計算期間	1,096,214,144	412,115,894
第 17 計算期間	1,255,999,989	444,192,637
2023 年 1 月 11 日～ 2023 年 7 月 10 日	533,239,485	291,495,909

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

2023年7月31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	26,934円
純資産総額	143億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	8.4%
6カ月間	10.8%
1年間	7.6%
3年間	50.3%
5年間	46.1%
設定来	169.3%

※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：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第 6 期 12年1月	第 7 期 13年1月	第 8 期 14年1月	第 9 期 15年1月	第 10 期 16年1月	第 11 期 17年1月	第 12 期 18年1月	第 13 期 19年1月	第 14 期 20年1月	第 15 期 21年1月	第 16 期 22年1月	第 17 期 23年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式・先物	99	24.4%
外国株式	159	20.1%
外国リート	70	19.8%
国内リート・先物	49	19.3%
国内債券	326	4.8%
外国債券	962	4.8%
外国優先出資証券	61	3.4%
コール・ローン、その他		4.2%
合計	1,726	－

通貨別構成	比率
日本円	50.8%
米ドル	31.0%
ユーロ	6.3%
豪ドル	3.4%
英ポンド	3.3%
シンガポール・ドル	1.5%
スイス・フラン	0.9%
カナダ・ドル	0.9%
香港ドル	0.8%
その他	1.1%
合計	100.0%

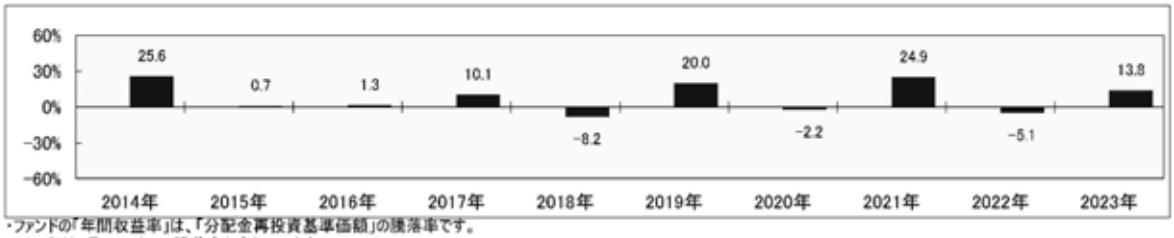
債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.6
最終利回り(%)	2.2
修正デュレーション	7.8
残存年数	9.2
債券格付別構成	**比率**
AAA	82.1%
AA	9.9%
A	6.5%
BBB	－
BB以下・無格付	1.4%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	トヨタ自動車	日本	1.3%
株式	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.2%
株式	APPLE INC	アメリカ	1.1%
株式	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
株式	東京海上HD	日本	1.0%
リート	日本ビルファンド	日本	1.6%
リート	日本プロロジスリート	日本	1.3%
リート	GLP投資法人	日本	1.2%
リート	日本都市ファンド投資法人	日本	1.0%
リート	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.0%
合計			11.8%

※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。無格付債券を1.4%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2023年は7月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1.01%	0.99%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	1.18%	1.16%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	1.34%	1.32%	0.02%

※対象期間は2022年1月12日～2023年1月10日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、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す。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す。

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。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

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）を計算期間の末日および償還時に作成し、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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

＜償還金にかかる請求権＞

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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。
　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、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】

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2022年1月12日から2023年1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3月3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ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2022年1月12日から2023年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2023年1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計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、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】

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1)　【貸借対照表】

	第16期 2022年1月11日現在 金　額（円）	第17期 2023年1月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,247,468	111,822,121
親投資信託受益証券	7,410,201,117	7,908,954,768
未収入金	4,946,000	7,728,000
流動資産合計	7,517,394,585	8,028,504,889
資産合計	7,517,394,585	8,028,504,889
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,150,367	9,710,688
未払受託者報酬	1,980,067	2,221,641
未払委託者報酬	33,661,828	37,768,687
その他未払費用	296,931	333,166
流動負債合計	40,089,193	50,034,182
負債合計	40,089,193	50,034,182
純資産の部		
元本等		
元本　※1	3,743,206,897	4,186,631,287
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,734,098,495	3,791,839,420
（分配準備積立金）	1,434,811,548	1,307,276,853
元本等合計	7,477,305,392	7,978,470,707
純資産合計	7,477,305,392	7,978,470,707
負債純資産合計	7,517,394,585	8,028,504,889

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第17期 自 2022年1月12日 至 2023年1月10日
	金　額（円）	金　額（円）
営業収益		
受取利息	17	10
有価証券売買等損益	848,486,385	△297,222,349
営業収益合計	848,486,402	△297,222,339
営業費用		
支払利息	20,485	29,425
受託者報酬	3,721,740	4,291,042
委託者報酬 ※1	63,270,843	72,949,152
その他費用	558,131	643,493
営業費用合計	67,571,199	77,913,112
営業利益又は営業損失（△）	780,915,203	△375,135,451
経常利益又は経常損失（△）	780,915,203	△375,135,451
当期純利益又は当期純損失（△）	780,915,203	△375,135,451
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	55,728,446	△7,750,923
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,540,303,816	3,734,098,495
剰余金増加額又は欠損金減少額	780,584,918	790,757,952
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	780,584,918	790,757,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	311,976,996	365,632,499
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	311,976,996	365,632,499
分配金 ※2	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,734,098,495	3,791,839,420

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2022年1月10日が休日のため、前計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1.　※1　期首元本額	3,298,446,758円	3,743,206,897円
期中追加設定元本額	842,864,166円	810,744,400円
期中一部解約元本額	398,104,027円	367,320,010円
2.　計算期間末日における受益権の総数	3,743,206,897口	4,186,631,287口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第16期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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	8,394,720円	9,532,625円
2.　※2　分配金の計算過程	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（0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（725,187,318円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,457,016,855円）及び	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（0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（3,045,580,029円）及び分配準備積立金

	分配準備積立金 （709,624,230円）より分配可能額は3,891,828,403円（1万口当たり10,397.04円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	（1,307,276,853円）より分配可能額は4,352,856,882円（1万口当たり10,397.04円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。

（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	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
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	第17期 2023年1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	第16期 2022年1月11日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第17期 2023年1月10日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	803,613,428	△300,528,296
合計	803,613,428	△300,528,296

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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）

	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9976円 （19,976円）	1.9057円 （19,057円）

(4)　【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)　株式
該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	647,312,252	1,974,431,831	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	1,630,806,680	1,988,116,423	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	350,726,914	1,193,067,743	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	221,786,367	788,428,356	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	138,629,610	611,148,635	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	68,720,962	156,738,770	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	10,032,864	29,654,136	

	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	349,951,698	1,167,368,874	
親投資信託受益証券　合計			7,908,954,768	
合計			7,908,954,768	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年1月11日現在	2023年1月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	782,658,662	2,518,881,640
コール・ローン	1,286,220,555	1,040,237,697
国債証券	231,934,468,036	230,386,538,826
派生商品評価勘定	1,902,825	9,300,270
未収入金	－	56,398,089
未収利息	1,353,281,206	1,560,920,037
前払費用	36,436,849	71,017,903
流動資産合計	235,394,968,133	235,643,294,462
資産合計	235,394,968,133	235,643,294,462
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,263,734	1,099,477
未払金	399,440,008	868,871,366
未払解約金	199,582,825	161,589,341
流動負債合計	600,286,567	1,031,560,184
負債合計	600,286,567	1,031,560,184
純資産の部		
元本等		
元本　※1	75,012,242,987	76,916,702,172
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	159,782,438,579	157,695,032,106
元本等合計	234,794,681,566	234,611,734,278
純資産合計	234,794,681,566	234,611,734,278
負債純資産合計	235,394,968,133	235,643,294,462

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1月12日 至　2023年1月10日
1.　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）、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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	70,827,785,140円	75,012,242,987円
期中追加設定元本額	9,881,422,933円	9,101,610,745円
期中一部解約元本額	5,696,965,086円	7,197,151,560円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

	ダイワ外国債券インデックスＶＡ	497,480,595 円	444,538,723 円
	ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	10,741,549 円	9,071,985 円
	ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	71,508,203 円	50,039,964 円
	ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	22,023,940 円	19,793,735 円
	ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	304,102,439 円	242,166,536 円
	外国債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	222,045,894 円	376,635,971 円
	ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	512,186,914 円	600,569,236 円
	ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,289,368,180 円	2,747,189,894 円
	ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	851,881,157 円	613,214,846 円
	Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックス	771,687 円	1,286,149 円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	7,731,046 円	13,305,885 円
	ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,788,987,761 円	2,029,809,603 円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,472,160,256 円	1,898,344,838 円
	ｉＦｒｅｅ 年金バランス	245,115,565 円	355,845,642 円
	ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,880,649,200 円	50,822,065,792 円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	987,056,953 円	1,086,461,266 円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	616,438,540 円	696,780,213 円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	400,595,480 円	459,259,897 円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	586,462,829 円	647,312,252 円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	448,579,124 円	508,972,778 円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	164,219,760 円	195,815,995 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	29,810,808 円	32,292,625 円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,141,715 円	14,308,175 円
ダイワつみたてインデックス外国債券	654,595,522 円	1,421,852,243 円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,467,222 円	4,055,482 円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,435,829 円	1,543,536 円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	1,957,134 円	2,610,007 円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	317,987 円	216,598,164 円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	161,809,831 円	119,575,140 円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	137,986,860 円	37,971,006 円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,827,374,287 円	3,260,578,750 円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	229,414,922 円	199,538,920 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,556,023 円	152,390,643 円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,893,681 円	51,334,584 円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,454,002,847 円	1,753,577,119 円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,815,822,364 円	5,725,230,060 円
ダイワライフスタイル２５	33,076,799 円	29,042,461 円
ダイワライフスタイル５０	65,158,726 円	60,480,650 円
ダイワライフスタイル７５	17,313,358 円	15,241,407 円
計	75,012,242,987 円	76,916,702,172 円
2. 期末日における受益権の総数	75,012,242,987 口	76,916,702,172 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 1 月 12 日 至 2023 年 1 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。 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	2023年1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1月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△5,111,074,474	△736,504,999
合計	△5,111,074,474	△736,504,999

（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（2021年12月1日から2022年1月11日まで、及び2022年12月1日から2023年1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1月11日 現在				2023年1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	－	－	－	－	36,373,263	－	37,376,908	△1,003,645
イスラエル・シュケル	－	－	－	－	36,373,263	－	37,376,908	△1,003,645
買　建	1,063,950,821	－	1,064,589,912	639,091	841,405,725	－	850,610,163	9,204,438
アメリカ・ドル	705,112,688	－	706,522,137	1,409,449	82,413,399	－	82,375,071	△38,328
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	26,678,245	－	27,168,575	490,330
オフショア・人民元	－	－	－	－	256,298,196	－	261,476,835	5,178,639
カナダ・ドル	－	－	－	－	151,114,315	－	152,822,662	1,708,347
シンガポール・ドル	32,163,335	－	32,165,116	1,781	－	－	－	－
ニュージーランド・ドル	－	－	－	－	11,472,712	－	11,554,602	81,890
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	8,241,330	－	8,183,826	△57,504
ポーランド・ズロチ	－	－	－	－	9,472,689	－	9,495,354	22,665
ユーロ	326,674,798	－	325,902,659	△772,139	295,714,839	－	297,533,238	1,818,399
合計	1,063,950,821	－	1,064,589,912	639,091	877,778,988	－	887,987,071	8,200,793

（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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1301円 (31,301円)	3.0502円 (30,502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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,126,250.150	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,782,274.080	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	906,530.850	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	784,409.240	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	798,073.200	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	834,066.240	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,692,433.370	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,302,043.680	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	983,324.650	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	598,355.720	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	574,548.570	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,031,460.720	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,207,059.170	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,174,734.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,319,892.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,134,623.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,826,200.960	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,114,565.600	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,571,874.070	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,427,302.800	

		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,482,458.250	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,511,007.850	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,316,774.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,469,350.590	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,197,878.550	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,435,469.520	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,378,034.600	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,357,228.900	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,977,429.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,109,416.440	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,049,785.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,193,966.740	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,088,886.610	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,970,115.320	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,719,066.930	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,712,580.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,393,413.600	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,494,385.530	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,042,582.850	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,535,874.720	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,596,303.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,458,491.780	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,594,241.410	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,572,820.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	573,066.400	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,542,070.380	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,498,221.320	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,191,525.340	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,236,549.980	

		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,979,178.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,092,478.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,960,005.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	849,140.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,442,100.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,431,246.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,418,024.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	2,035,460.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,237,900.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,419,096.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,051,456.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,736,240.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,903,820.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,121,602.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,315,520.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,539,510.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,896,980.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,201,905.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,921,080.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,409,850.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,150,200.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,072,250.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,376,380.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,077,984.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,696,848.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,072,886.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,514,564.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,623,428.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,607,420.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,810,158.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,383,026.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,246,565.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,850,125.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,453,866.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,908,710.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,428,851.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,803,976.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,432,300.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,486,204.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,435,525.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,434,750.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,597,510.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,820,921.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,911,170.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,446,525.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,451,275.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,234,360.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,911,120.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,409,075.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	4,110,009.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,396,175.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,220,305.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,378,200.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,975,285.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,623,646.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,399,095.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,672,124.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,835,570.000	

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,365,180.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,625,308.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,280,000.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,338,475.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,173,412.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,450,598.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,568,440.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,804,040.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,314,150.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,861,520.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	951,850.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,771,820.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,547,957.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,470,085.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,846,240.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,852,100.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,317,375.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,385,250.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,606,891.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,371,050.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,947,955.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,806,568.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	270,375.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,882,488.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,387,140.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,407,808.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,535,880.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,481,246.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,095,968.000	

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,238,984.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,303,300.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,046,750.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,741,820.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,933,265.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,041,710.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,091,722.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,480,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,309,150.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	4,003,250.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,283,200.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,026,520.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,623,560.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,429,840.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,173,100.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,065,400.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,608,720.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,442,320.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,342,412.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,488,910.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,604,739.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,322,250.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,311,300.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	901,950.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,821,560.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,062,910.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	4,018,195.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,975,374.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,762,750.000	

		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,493,350.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,408,200.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,496,048.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,700,450.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,901,480.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,542,320.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,623,560.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,846,340.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,533,939.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,815,471.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,066,875.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,304,840.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,901,952.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,003,330.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,529,840.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,966,952.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,883,280.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,406,400.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,520,850.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,176,545.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,815,530.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,610,903.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,837,521.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,666,220.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,363,160.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,335,900.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,357,600.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,480,250.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,021,575.000	

		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,383,000.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,146,150.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,876,780.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,220,640.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	12,000,000.000	10,072,440.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,480,212.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	3,007,960.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,289,120.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,339,900.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,634,040.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,965,352.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,069,364.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,406,950.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,523,560.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,629,680.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	941,090.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,883,180.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	9,087,000.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,501,828.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,859,250.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,901,366.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	2,004,325.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,523,000.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,863,640.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	928,200.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,753,700.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,789,040.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,757,000.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,944,840.000	

		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,936,400.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,826,258.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,910,930.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,270,700.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,380,225.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,383,630.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,869,920.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,882,100.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,378,500.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,697,420.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,911,560.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,945,780.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,910,440.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,941,260.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,925,570.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,906,060.400	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	979,060.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,444,425.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,500,000.000	7,033,575.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,567,056.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	937,180.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,885,756.600	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,165,086.400	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,821,963.900	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,439,925.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,397,450.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,270,974.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,495,345.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,537,400.000	

		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,527,420.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,422,814.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	1,001,230.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,056,010.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	5,000,000.000	5,247,250.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,520,970.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	1,900,000.000	2,019,624.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,068,880.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	3,012,420.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,539,450.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,028,590.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	1,000,000.000	1,025,460.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,505,180.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 881,702,658.580 (116,252,495,533)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	888,838.680	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	939,898.300	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,370,551.450	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,074,392.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,102,333.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,093,421.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,281,605.400	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,361,250.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	566,363.200	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,746,036.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	774,968.700	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	499,800.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,268,640.000	

		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,781,326.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	762,885.200	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,025,778.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	600,695.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,360,950.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,355,120.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	490,347.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,168,274.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,255,436.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,898,000.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	1,061,080.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	445,900.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	800,000.000	432,328.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,027,620.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	599,319.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	585,445.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,740,410.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	171,468.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	2,100,000.000	1,684,200.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	353,789.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,029,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	975,660.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,072,569.290	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,369,001.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,518,794.880	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,420,566.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,487,014.170	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,814,340.080	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,405,409.100	

		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,275,588.160	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,257,729.680	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,739,968.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,392,677.570	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,495,106.160	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,678,638.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,213,622.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,626,265.480	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,492,154.880	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,655,776.440	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,301,454.000	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,079,125.320	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,403,375.400	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 67,473,105.140 (10,827,409,182)	
	イスラエル・シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
		6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,975,122.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,047,792.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	1,996,920.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,193,211.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,701,414.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,477,424.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,132,980.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,050,800.000	
		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,488,240.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,329,111.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,218.000	
		0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	848,187.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	252,669.000	
	イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル	

				19,676,088.000 (746,707,539)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,094,138.540	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,160.900	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,331,659.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,796,399.780	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,341,053.160	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,797,083.840	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,088,547.390	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,162,694.130	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	716,760.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,620,117.840	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,107,779.420	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,040,775.080	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,440,120.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,804,183.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,663,733.100	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,149,821.900	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,393,211.200	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,371,526.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,270,160.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,635,180.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	858,326.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,467,152.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,993,575.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,080,708.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,341,472.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,212,822.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,196,568.000	

	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 39,544,727.280 (3,602,524,655)	
	オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
		3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,323,188.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,153,550.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,188,000.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,125,600.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,241,560.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,196,400.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,114,400.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,432,335.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,285,120.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,281,250.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	12,959,375.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,122,850.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,030,730.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,115,010.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,148,420.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,019,304.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,518,000.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,049,350.000	
		3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,235,620.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,771,865.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,393,300.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,300,350.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,560,660.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,735,575.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,146,110.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	6,954,444.000	

		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,386,980.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,259,560.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,557,750.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,668,700.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,009,600.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,839,010.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,119,288.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,975,100.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,003,300.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,595,645.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	4,949,000.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	3,989,720.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,936,240.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,832,750.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	12,000,000.000	11,711,280.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,878,120.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,391,700.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,066,012.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	3,931,480.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,479,925.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	17,914,680.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	12,000,000.000	11,989,080.000	
	オフショア・人民元　小計			オフショア・人民元 466,887,286.000 (9,083,385,527)	
	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	557,731.350	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,135,286.360	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,376,668.990	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,225,997.520	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,017,766.750	

		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,016,997.470	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,375,677.650	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,251,405.260	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,119,898.120	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	911,170.080	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,132,640.800	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	616,161.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,935,389.100	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,164,917.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,174,176.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,346,492.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,041,692.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	663,943.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,661,632.200	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,643,900.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,896,699.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,144,776.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	275,628.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,007,878.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	947,620.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,947,856.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	184,386.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,891,280.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,845,312.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	190,318.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	386,656.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,370,385.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,248.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	392,220.000	

		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	196,154.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	983,280.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	733,109.300	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	354,265.200	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	203,074.000	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	299,373.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,715,060.650 (4,597,696,269)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	793,616.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	922,649.260	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	809,809.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	413,172.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	593,560.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	626,750.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	517,450.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	720,336.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	439,920.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	698,670.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	546,150.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	483,870.100	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	327,250.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	474,120.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	702,525.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	544,056.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	177,726.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	189,240.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	234,912.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	243,630.200	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,680.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 10,560,091.560 (1,045,871,468)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	スウェーデン・クローナ 3,655,000.000	スウェーデン・クローナ 4,409,465.100	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,576,923.900	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,824,231.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,687,309.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,352,140.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,849,856.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,243,850.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 36,943,775.000 (467,708,192)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 13,662,000.000	デンマーク・クローネ 17,580,808.080	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,882,397.640	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,660,278.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,565,728.400	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,031,225.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	403,380.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	953,520.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 39,077,337.120 (742,860,179)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	ニュージーランド・ドル 600,000.000	ニュージーランド・ドル 602,874.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	400,000.000	374,756.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	403,980.500	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	558,192.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	428,849.500	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	231,553.000	

		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20240515	700,000.000	659,554.000	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	323,860.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	438,655.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	364,377.200	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	282,925.200	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,465.600	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	199,142.000	
	ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 5,482,184.000 (460,503,456)	
	ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,080,995.100	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,235,038.250	
		1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,137,842.800	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,229,947.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,326,225.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,545,888.500	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	6,010,860.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,006,500.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,563,014.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 35,136,311.150 (466,961,575)	
	ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
		2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,920,435.130	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,778,188.000	
		2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,749,718.300	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,056,016.800	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,194,810.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,793,100.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,170,080.000	

		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,797,400.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	915,100.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,285,200.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	461,460.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	832,292.800	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,172,324.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,318,845.520	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 33,444,971.050 (1,007,870,891)	
	マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,345,924.070	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,217,451.220	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,548,201.260	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,323,179.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	734,567.280	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,404,867.230	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,867,950.980	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,399,918.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,068,003.370	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,754,074.710	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,229,028.000	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	966,762.900	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,559,238.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,564,725.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,196,437.900	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,057,835.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,208,208.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,260,624.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	641,136.000	

		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	654,680.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,301,545.400	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,267,368.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	399,924.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,268,449.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,622,355.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,447,725.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,630,782.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,357,300.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	421,740.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	514,875.000	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 40,234,875.820 (1,212,675,134)	
	メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
		5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,036,820.400	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,790,256.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,029,356.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,229,860.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	911,990.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	9,000,000.000	8,373,240.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,261,500.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	24,053,185.590	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,885,079.040	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,877,649.400	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,487,275.520	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,551,073.900	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	31,014,107.600	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,665,513.180	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,446,467.280	
	メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 268,613,373.910 (1,850,773,007)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	310,786.840	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	266,899.770	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	761,488.450	

		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	276,897.600	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	724,832.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	392,421.800	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	444,230.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	434,220.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	191,604.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	216,569.100	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	254,400.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	405,120.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	200,864.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	479,328.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	182,010.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	288,697.500	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	267,402.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	256,062.600	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,326,070.860	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,056,401.940	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	602,833.280	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	160,197.600	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,173,888.000	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	437,113.800	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,097,040.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,123,532.800	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	769,512.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	808,078.600	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	427,126.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	238,408.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	168,763.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	960,756.000	

		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	452,520.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	418,176.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	148,362.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	257,874.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	423,640.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	247,194.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	294,900.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,628,780.330	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,547,371.500	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	903,521.420	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,391,254.480	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	930,076.600	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	615,398.800	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,019,711.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,011,769.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	490,825.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	486,894.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,362,411.300	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	560,430.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,353,750.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	521,388.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,013,515.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	546,349.400	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,063,764.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,261,568.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	248,898.600	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	318,692.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	538,480.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	380,128.000	

		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,008,869.200	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,377,806.880	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,504,806.720	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,072,702.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,457,460.090	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,768,272.880	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,882,356.400	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,927,489.700	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,675,621.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,337,494.240	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,275,192.920	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,935,427.040	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,547,981.260	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,828,863.260	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,572,034.680	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,946,406.700	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,106,130.300	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,058,456.400	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,941,177.440	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,230,562.400	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,874,836.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,055,008.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,283,588.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,744,827.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,682,169.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	1,959,628.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,601,450.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,605,975.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,501,692.500	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,581,636.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,798,080.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,529,442.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,020,324.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	755,955.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,029,028.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,762,060.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	621,170.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	2,990,952.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	581,777.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,117,254.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	331,656.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,579,688.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,101,624.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	198,446.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	650,880.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	97,031.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	96,703.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	511,296.300	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,489,005.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,859,616.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,626,305.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,271,576.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,155,951.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,090.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,042,238.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,192,594.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	90,824.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,872,080.000	

		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	412,391.500	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,297,582.750	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,893,592.330	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,062,212.140	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,150,409.790	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,121,651.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,661,016.600	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,803,128.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,501,924.040	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,750,858.960	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,963,122.130	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,209,358.400	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,049,849.160	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,075,554.250	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,815,031.140	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,322,917.360	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,881,708.010	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,717,977.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,097,414.130	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,382,768.290	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,028,571.460	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,710,529.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,175,376.500	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,185,256.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,099,593.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,919,454.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,335,814.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,473,859.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,292,662.000	

		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,069,128.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,835,786.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,085,484.900	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,536,106.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,591,752.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,770,200.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,457,016.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,272,000.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	633,854.400	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	97,036.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	922,980.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,653,826.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,795,766.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,178,352.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,638,987.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,984,395.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	156,864.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	274,374.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	2,800,000.000	2,626,428.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	916,470.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,302,127.580	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,031,430.050	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,028,774.020	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,459,676.440	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,037,737.730	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,500,934.180	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,693,623.330	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,811,894.340	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,045,054.000	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,364,174.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,237,990.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,045,560.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	645,741.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,166,802.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	726,008.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	652,125.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,055,795.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	613,323.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	778,572.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	92,736.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	498,174.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	275,103.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,267,531.200	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,715,254.880	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,797,583.300	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,273,279.110	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,396,199.630	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,695,592.150	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,794,729.700	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,229,653.600	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,255,772.120	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,842,374.240	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	987,120.360	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	689,245.040	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,271,160.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,437,882.400	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,279,070.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,430,137.500	

		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,543,562.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,555,776.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,096,836.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,951,404.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,253,772.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,438,310.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,524,177.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,148,969.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,518,082.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,818,281.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,158,816.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,014,320.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,054,500.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,603,011.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,230,268.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,131,215.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,095,850.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,077,435.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,453,095.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,615,320.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,777,650.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,964,248.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,562,402.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,024,830.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,497,903.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,067,165.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	707,160.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	457,646.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,599,990.000	

		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,364,922.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	420,672.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	988,328.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,444,125.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	275,793.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	675,168.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,468,073.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	953,350.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,162,596.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,755,590.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,294,788.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	738,864.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	283,311.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	514,208.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	272,823.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	475,025.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	754,096.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,389,360.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	261,849.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	98,183.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	191,848.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	483,945.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	301,353.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	300,000.000	302,865.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	298,857.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,479,795.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,560,884.740	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,277,090.740	

		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,032,321.700	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,439,189.120	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,657,580.800	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,184,443.240	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,202,423.480	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,403,082.910	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,143,816.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,546,357.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,894,077.360	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,229,564.740	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,224,572.710	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,279,845.720	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,949,992.120	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,284,571.520	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,845,113.280	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,060,869.810	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	853,686.600	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	709,839.850	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,502,637.150	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	748,874.970	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,091,560.940	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	612,657.240	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	949,218.140	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	779,675.260	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,024,296.530	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	470,294.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	735,936.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	651,412.500	

		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	684,472.500	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	869,905.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	442,470.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	259,934.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	452,970.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	665,960.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	635,280.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	262,580.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	79,997.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	958,056.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,561,554.090	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	938,411.250	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	411,677.240	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	748,413.450	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	733,174.740	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	915,764.560	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	690,938.630	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	392,080.880	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	393,210.840	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	524,641.040	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,107,931.840	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,994,795.250	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,905,877.080	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,161,158.560	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,663,253.840	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,749,011.520	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,461,882.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,494,555.000	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,801,694.000	

		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,607,900.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,922,490.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,225,592.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,022,496.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,680,122.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,466,720.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,894,815.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,213,175.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,400,496.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,147,584.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,364,175.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	772,842.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,193,264.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,106,768.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	889,850.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	459,300.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,725,834.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	288,681.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	324,317.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	432,925.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,317,023.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,519,734.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	385,332.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	803,223.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,684,032.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	407,082.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	93,628.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	87,032.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,599,156.000	

		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	966,320.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,652,365.960	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,896,214.320	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,158,000.000	1,367,030.580	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,717,187.440	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,280,196.100	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,920,947.590	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,172,680.850	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,976,736.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,608,421.800	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	1,994,191.600	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,097,545.220	
	ユーロ　小計			ユーロ 551,853,842.260 (78,021,096,219)	
国債証券　合計				230,386,538,826 [230,386,538,826]	
合計				230,386,538,826 [230,386,538,826]	

（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	265 銘柄	100%	50.5%
イギリス・ポンド	国債証券	55 銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	13 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	27 銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券	48 銘柄	100%	3.9%
カナダ・ドル	国債証券	40 銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	21 銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7 銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券	13 銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9 銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14 銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	30 銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15 銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	361 銘柄	100%	33.9%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」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1月11日現在	2023年1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	187,747,349	194,868,389
国債証券	33,228,681,850	38,233,810,170
地方債証券	1,661,017,000	1,429,751,600
特殊債券	832,738,000	718,256,200
社債券	1,321,353,100	1,276,323,100
未収利息	47,155,585	52,671,029
前払費用	1,712,564	1,285,012
流動資産合計	37,280,405,448	41,906,965,500
資産合計	37,280,405,448	41,906,965,500
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,307,834	20,206,575
流動負債合計	1,307,834	20,206,575
負債合計	1,307,834	20,206,575
純資産の部		
元本等		
元本　※1	29,034,289,083	34,357,539,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,244,808,531	7,529,219,365
元本等合計	37,279,097,614	41,886,758,925
純資産合計	37,279,097,614	41,886,758,925
負債純資産合計	37,280,405,448	41,906,965,500

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1月12日 至　2023年1月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	19,879,992,868円	29,034,289,083円
期中追加設定元本額	9,440,596,151円	6,199,700,919円
期中一部解約元本額	286,299,936円	876,450,442円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	835,787,692円	1,590,144,831円
ｉＦｒｅｅ　日本債券インデックス	3,554,950,837円	3,689,758,964円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	3,591,914,229円	4,785,631,215円
ダイワ・ライフ・バランス３０	8,822,756,090円	9,984,415,766円
ダイワ・ライフ・バランス５０	6,013,737,455円	6,969,138,828円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,953,751,471円	2,307,175,970円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,429,239,873円	1,630,806,680円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,094,214,275円	1,279,480,111円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	400,305,943円	490,703,172円

ダイワつみたてインデックス日本債券	797,503,964 円	1,294,154,625 円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	30,973,755 円	36,787,697 円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	14,028,003 円	15,311,192 円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	9,541,751 円	13,026,438 円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	282,914,962 円	213,856,456 円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	202,668,783 円	57,147,615 円
計	29,034,289,083 円	34,357,539,560 円
2. 期末日における受益権の総数	29,034,289,083 口	34,357,539,560 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 1 月 12 日 至 2023 年 1 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	2023 年 1 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1月11日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	△251,973,650	△666,375,170
地方債証券	△8,123,000	△11,831,900
特殊債券	△3,543,700	△4,361,400
社債券	△5,070,200	△11,356,600
合計	△268,710,550	△693,925,070

（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（2021年12月1日から2022年1月11日まで、及び2022年12月1日から2023年1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1月11日現在	2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2840円 （12,840円）	1.2191円 （12,191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	４３３　２年国債	250,000,000	250,037,500	
	４３４　２年国債	170,000,000	170,028,900	
	４３５　２年国債	30,000,000	30,003,600	
	４３６　２年国債	200,000,000	200,012,000	
	４３７　２年国債	150,000,000	150,000,000	
	４３８　２年国債	20,000,000	19,998,400	
	４３９　２年国債	390,000,000	389,937,600	
	４４０　２年国債	200,000,000	199,966,000	
	４４１　２年国債	80,000,000	79,985,600	
	４４２　２年国債	200,000,000	199,962,000	
	１３９　５年国債	640,000,000	640,793,600	
	１４０　５年国債	470,000,000	470,573,400	
	１４１　５年国債	620,000,000	620,886,600	
	１４２　５年国債	320,000,000	320,496,000	
	１４３　５年国債	630,000,000	630,957,600	
	１４４　５年国債	580,000,000	580,916,400	

	１４５　５年国債	710,000,000	711,143,100	
	１４６　５年国債	360,000,000	360,579,600	
	１４７　５年国債	580,000,000	579,072,000	
	１４８　５年国債	500,000,000	498,710,000	
	１４９　５年国債	450,000,000	448,263,000	
	１５０　５年国債	330,000,000	328,254,300	
	１５１　５年国債	450,000,000	446,913,000	
	１５３　５年国債	370,000,000	366,825,400	
	１５４　５年国債	440,000,000	437,443,600	
	１　４０年国債	30,000,000	35,553,000	
	２　４０年国債	48,000,000	54,728,640	
	３　４０年国債	19,000,000	21,715,100	
	４　４０年国債	54,000,000	61,427,160	
	５　４０年国債	61,000,000	66,582,720	
	６　４０年国債	40,000,000	42,572,400	
	７　４０年国債	41,000,000	41,593,270	
	８　４０年国債	40,000,000	37,542,400	
	９　４０年国債	40,000,000	27,288,000	
	１０　４０年国債	91,000,000	73,124,870	
	１１　４０年国債	85,000,000	65,698,200	
	１２　４０年国債	99,000,000	67,967,460	
	１３　４０年国債	252,000,000	171,753,120	
	１４　４０年国債	273,000,000	198,959,670	
	１５　４０年国債	250,000,000	198,567,500	
	３３３　１０年国債	83,000,000	83,595,110	
	３３４　１０年国債	320,000,000	322,691,200	
	３３５　１０年国債	210,000,000	211,719,900	
	３３７　１０年国債	300,000,000	301,626,000	
	３３８　１０年国債	80,000,000	80,646,400	
	３３９　１０年国債	135,000,000	136,200,150	
	３４０　１０年国債	190,000,000	191,837,300	
	３４１　１０年国債	15,000,000	15,112,200	
	３４２　１０年国債	140,000,000	140,200,200	
	３４３　１０年国債	270,000,000	270,183,600	
	３４４　１０年国債	90,000,000	89,966,700	
	３４５　１０年国債	410,000,000	409,356,300	
	３４６　１０年国債	250,000,000	249,272,500	
	３４７　１０年国債	400,000,000	398,240,000	
	３４８　１０年国債	430,000,000	427,501,700	
	３４９　１０年国債	380,000,000	377,218,400	
	３５０　１０年国債	480,000,000	475,704,000	
	３５１　１０年国債	470,000,000	464,844,100	
	３５２　１０年国債	500,000,000	493,575,000	
	３５３　１０年国債	440,000,000	433,598,000	
	３５４　１０年国債	410,000,000	403,304,700	
	３５５　１０年国債	350,000,000	343,514,500	
	３５６　１０年国債	390,000,000	382,001,100	
	３５７　１０年国債	360,000,000	351,756,000	
	３５８　１０年国債	480,000,000	467,649,600	

	３５９　１０年国債	390,000,000	378,947,400	
	３６０　１０年国債	460,000,000	445,712,400	
	３６１　１０年国債	460,000,000	444,755,600	
	３６２　１０年国債	450,000,000	434,133,000	
	３６３　１０年国債	380,000,000	365,913,400	
	３６４　１０年国債	400,000,000	384,748,000	
	３６５　１０年国債	350,000,000	336,721,000	
	３６６　１０年国債	390,000,000	379,723,500	
	３６７　１０年国債	360,000,000	352,328,400	
	３６８　１０年国債	400,000,000	391,988,000	
	２　３０年国債	9,000,000	10,223,100	
	３　３０年国債	4,000,000	4,525,080	
	４　３０年国債	8,000,000	9,462,320	
	５　３０年国債	8,000,000	9,079,520	
	６　３０年国債	9,000,000	10,441,530	
	７　３０年国債	12,000,000	13,899,000	
	１０　３０年国債	25,000,000	26,199,750	
	１１　３０年国債	9,000,000	9,957,780	
	１２　３０年国債	11,000,000	12,613,150	
	１３　３０年国債	11,000,000	12,497,540	
	１４　３０年国債	22,000,000	25,933,600	
	１５　３０年国債	21,000,000	25,003,020	
	１６　３０年国債	26,000,000	30,973,540	
	１７　３０年国債	17,000,000	20,062,720	
	１８　３０年国債	20,000,000	23,383,000	
	１９　３０年国債	15,000,000	17,545,350	
	２０　３０年国債	16,000,000	19,111,520	
	２１　３０年国債	16,000,000	18,737,280	
	２２　３０年国債	17,000,000	20,337,950	
	２３　３０年国債	16,000,000	19,137,760	
	２４　３０年国債	15,000,000	17,958,000	
	２５　３０年国債	17,000,000	19,923,150	
	２６　３０年国債	32,000,000	37,919,040	
	２７　３０年国債	32,000,000	38,344,640	
	２８　３０年国債	34,000,000	40,750,700	
	２９　３０年国債	43,000,000	50,888,350	
	３０　３０年国債	56,000,000	65,412,480	
	３１　３０年国債	76,000,000	87,541,360	
	３２　３０年国債	45,000,000	52,501,500	
	３３　３０年国債	95,000,000	106,167,250	
	３４　３０年国債	110,000,000	126,420,800	
	３５　３０年国債	120,000,000	134,041,200	
	３６　３０年国債	138,000,000	154,255,020	
	３７　３０年国債	165,000,000	181,658,400	
	３８　３０年国債	110,000,000	119,079,400	
	３９　３０年国債	105,000,000	115,452,750	
	４０　３０年国債	80,000,000	86,451,200	
	４１　３０年国債	80,000,000	84,916,800	
	４２　３０年国債	85,000,000	90,123,800	

	４３　３０年国債	95,000,000	100,611,650	
	４４　３０年国債	85,000,000	89,915,550	
	４５　３０年国債	105,000,000	107,031,750	
	４６　３０年国債	115,000,000	117,044,700	
	４７　３０年国債	125,000,000	129,378,750	
	４８　３０年国債	110,000,000	109,434,600	
	４９　３０年国債	120,000,000	119,172,000	
	５０　３０年国債	110,000,000	96,091,600	
	５１　３０年国債	155,000,000	119,632,100	
	５２　３０年国債	120,000,000	96,990,000	
	５３　３０年国債	95,000,000	78,352,200	
	５４　３０年国債	118,000,000	101,714,820	
	５５　３０年国債	96,000,000	82,507,200	
	５６　３０年国債	100,000,000	85,689,000	
	５７　３０年国債	105,000,000	89,705,700	
	５８　３０年国債	165,000,000	140,419,950	
	５９　３０年国債	97,000,000	80,272,350	
	６０　３０年国債	100,000,000	86,624,000	
	６１　３０年国債	95,000,000	77,968,400	
	６２　３０年国債	110,000,000	85,308,300	
	６３　３０年国債	110,000,000	82,634,200	
	６４　３０年国債	90,000,000	67,344,300	
	６５　３０年国債	86,000,000	64,743,380	
	６６　３０年国債	115,000,000	86,161,450	
	６７　３０年国債	140,000,000	109,544,400	
	６８　３０年国債	106,000,000	82,646,080	
	６９　３０年国債	106,000,000	84,795,760	
	７０　３０年国債	166,000,000	132,472,980	
	７１　３０年国債	66,000,000	52,541,280	
	７２　３０年国債	203,000,000	161,208,390	
	７３　３０年国債	120,000,000	95,245,200	
	７４　３０年国債	155,000,000	133,313,950	
	７５　３０年国債	160,000,000	148,904,000	
	７６　３０年国債	80,000,000	76,014,400	
	６７　２０年国債	19,000,000	19,429,400	
	６８　２０年国債	25,000,000	25,653,750	
	６９　２０年国債	12,000,000	12,299,640	
	７０　２０年国債	18,000,000	18,617,220	
	７１　２０年国債	17,000,000	17,534,140	
	７２　２０年国債	53,000,000	54,867,190	
	７５　２０年国債	14,000,000	14,633,080	
	７６　２０年国債	25,000,000	26,021,250	
	７８　２０年国債	17,000,000	17,772,310	
	７９　２０年国債	14,000,000	14,670,180	
	８１　２０年国債	65,000,000	68,423,550	
	８２　２０年国債	28,000,000	29,550,080	
	８５　２０年国債	31,000,000	33,016,240	
	８６　２０年国債	6,000,000	6,428,400	
	８７　２０年国債	35,000,000	37,387,700	

	８８　２０年国債	33,000,000	35,511,960	
	８９　２０年国債	15,000,000	16,090,350	
	９２　２０年国債	60,000,000	64,620,000	
	９３　２０年国債	18,000,000	19,373,220	
	９４　２０年国債	45,000,000	48,619,800	
	９５　２０年国債	30,000,000	32,778,600	
	９６　２０年国債	63,000,000	68,280,660	
	９７　２０年国債	25,000,000	27,304,250	
	９８　２０年国債	64,000,000	69,601,920	
	９９　２０年国債	53,000,000	57,812,400	
	１００　２０年国債	35,000,000	38,474,450	
	１０１　２０年国債	18,000,000	19,971,180	
	１０２　２０年国債	10,000,000	11,129,600	
	１０３　２０年国債	21,000,000	23,259,810	
	１０４　２０年国債	64,000,000	70,201,600	
	１０５　２０年国債	38,000,000	41,791,640	
	１０６　２０年国債	16,000,000	17,685,920	
	１０７　２０年国債	40,000,000	44,111,600	
	１０８　２０年国債	68,000,000	74,197,520	
	１０９　２０年国債	60,000,000	65,631,000	
	１１０　２０年国債	27,000,000	29,860,920	
	１１１　２０年国債	35,000,000	39,015,200	
	１１２　２０年国債	40,000,000	44,337,600	
	１１３　２０年国債	70,000,000	77,804,300	
	１１４　２０年国債	45,000,000	50,114,700	
	１１５　２０年国債	42,000,000	47,056,800	
	１１６　２０年国債	27,000,000	30,310,200	
	１１７　２０年国債	77,000,000	85,903,510	
	１１８　２０年国債	13,000,000	14,434,680	
	１１９　２０年国債	23,000,000	25,198,340	
	１２０　２０年国債	98,000,000	105,958,580	
	１２３　２０年国債	42,000,000	47,131,560	
	１２４　２０年国債	100,000,000	111,454,000	
	１２５　２０年国債	25,000,000	28,320,000	
	１２６　２０年国債	21,000,000	23,449,440	
	１２７　２０年国債	110,000,000	121,966,900	
	１２８　２０年国債	32,000,000	35,555,200	
	１２９　２０年国債	95,000,000	104,786,900	
	１３０　２０年国債	28,000,000	30,941,120	
	１３１　２０年国債	150,000,000	164,511,000	
	１３２　２０年国債	25,000,000	27,484,750	
	１３３　２０年国債	150,000,000	166,188,000	
	１３４　２０年国債	15,000,000	16,654,050	
	１３５　２０年国債	20,000,000	22,030,400	
	１３６　２０年国債	180,000,000	196,698,600	
	１３７　２０年国債	18,000,000	19,884,060	
	１３９　２０年国債	250,000,000	273,920,000	
	１４０　２０年国債	100,000,000	110,681,000	
	１４１　２０年国債	48,000,000	53,151,840	

	１４２　２０年国債	185,000,000	206,598,750	
	１４３　２０年国債	100,000,000	109,704,000	
	１４４　２０年国債	130,000,000	141,367,200	
	１４５　２０年国債	210,000,000	232,348,200	
	１４６　２０年国債	200,000,000	221,100,000	
	１４７　２０年国債	220,000,000	240,730,600	
	１４８　２０年国債	195,000,000	211,073,850	
	１４９　２０年国債	240,000,000	259,507,200	
	１５０　２０年国債	225,000,000	240,459,750	
	１５１　２０年国債	260,000,000	271,481,600	
	１５２　２０年国債	200,000,000	208,420,000	
	１５３　２０年国債	275,000,000	289,407,250	
	１５４　２０年国債	230,000,000	238,947,000	
	１５５　２０年国債	220,000,000	222,807,200	
	１５６　２０年国債	200,000,000	187,218,000	
	１５７　２０年国債	210,000,000	190,436,400	
	１５８　２０年国債	225,000,000	211,835,250	
	１５９　２０年国債	220,000,000	209,233,200	
	１６０　２０年国債	190,000,000	182,576,700	
	１６１　２０年国債	200,000,000	188,834,000	
	１６２　２０年国債	210,000,000	197,469,300	
	１６３　２０年国債	160,000,000	149,830,400	
	１６４　２０年国債	260,000,000	238,921,800	
	１６５　２０年国債	155,000,000	141,883,900	
	１６６　２０年国債	215,000,000	202,005,400	
	１６７　２０年国債	160,000,000	145,110,400	
	１６８　２０年国債	250,000,000	222,137,500	
	１６９　２０年国債	155,000,000	134,735,300	
	１７０　２０年国債	175,000,000	151,413,500	
	１７１　２０年国債	140,000,000	120,563,800	
	１７２　２０年国債	215,000,000	187,684,250	
	１７３　２０年国債	200,000,000	173,794,000	
	１７４　２０年国債	230,000,000	198,938,500	
	１７５　２０年国債	165,000,000	144,744,600	
	１７６　２０年国債	170,000,000	148,574,900	
	１７７　２０年国債	180,000,000	153,844,200	
	１７８　２０年国債	190,000,000	165,034,000	
	１７９　２０年国債	190,000,000	164,646,400	
	１８０　２０年国債	160,000,000	146,366,400	
	１８１　２０年国債	160,000,000	148,913,600	
	１８２　２０年国債	140,000,000	134,764,000	
	１　フイリピン共和国	100,000,000	97,309,800	
国債証券　合計			38,233,810,170	
地方債証券	７５１　東京都公債	100,000,000	100,555,600	
	２７－１５　北海道公債	100,000,000	100,032,000	
	３－５　北海道公債	100,000,000	94,998,900	
	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,484,500	
	４０１　大阪府公債	100,000,000	100,769,000	
	３　兵庫県公債１２年	100,000,000	100,851,000	

	１１兵庫県公債２０年	100,000,000	108,364,200	
	２８－１　静岡県公債	100,000,000	99,648,700	
	９　埼玉県２０年	100,000,000	110,693,500	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	104,245,500	
	２９－６　千葉県公債	100,000,000	99,307,600	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	99,626,400	
	２７－１　滋賀県公債	100,000,000	100,841,500	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	110,333,200	
地方債証券　合計			1,429,751,600	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	102,378,700	
	８１　政保道路機構	100,000,000	110,195,800	
	２４１　政保道路機構	100,000,000	100,753,700	
	２６１　政保道路機構	100,000,000	100,723,000	
	６５　地方公共団体	100,000,000	100,544,200	
	１２７　都市再生	100,000,000	99,046,400	
	８０　住宅支援機構	100,000,000	104,614,400	
特殊債券　合計			718,256,200	
社債券	２０　成田国際空港	100,000,000	99,121,700	
	２５　西日本高速道	100,000,000	100,518,000	
	１４　セブンアンドアイ	100,000,000	99,508,300	
	１８　楽天グループ	100,000,000	83,412,000	
	１７　パナソニツク	100,000,000	99,682,700	
	６　楽天カード	100,000,000	95,583,800	
	５　ＮＴＴフアイナンス	100,000,000	95,465,200	
	７　三井住友海上	100,000,000	98,902,500	
	８０　三菱地所	100,000,000	107,631,200	
	３２東日本旅客鉄道	100,000,000	102,456,300	
	９　ソフトバンク	100,000,000	97,673,700	
	４９７　関西電力	100,000,000	101,398,900	
	６５　東京瓦斯	100,000,000	94,968,800	
社債券　合計			1,276,323,100	
合計			41,658,141,070	

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年1月11日現在 金　額（円）	2023年1月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,456,452,366	1,769,322,727
コール・ローン	2,958,755,265	1,140,163,619
投資証券	99,439,316,741	85,471,341,765
派生商品評価勘定	－	119,040
未収入金	1,171,981	80,683,124
未収配当金	294,129,454	336,694,099
流動資産合計	105,149,825,807	88,798,324,374
資産合計	105,149,825,807	88,798,324,374
負債の部		
流動負債		
未払金	152,433,507	－
未払解約金	172,820,000	－
流動負債合計	325,253,507	－
負債合計	325,253,507	－
純資産の部		
元本等		
元本　※1	27,937,030,793	26,103,872,416
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	76,887,541,507	62,694,451,958
元本等合計	104,824,572,300	88,798,324,374
純資産合計	104,824,572,300	88,798,324,374
負債純資産合計	105,149,825,807	88,798,324,374

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 1 月 12 日 至　2023 年 1 月 10 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	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、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。
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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	28,120,093,755円	27,937,030,793円
期中追加設定元本額	3,308,769,622円	2,056,719,172円
期中一部解約元本額	3,491,832,584円	3,889,877,549円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
グローバルＲＥＩＴ・オープン（適格機関投資家専用）	－円	827,530円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（毎月分配型）	22,952,455,720円	20,761,785,781円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	23,088,121円	21,910,958円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,160,653円	10,398,209円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,582,433円	8,387,412円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	41,200,851円	40,981,474円
６資産バランスファンド（分配型）	81,794,302円	73,723,724円
６資産バランスファンド（成長型）	229,846,740円	211,607,553円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,042,949,524円	946,777,236円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	22,940,941円	20,521,015円
常陽３分法ファンド	97,872,159円	92,469,284円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	24,834,133円	24,349,056円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／毎月分配型）	10,526,946円	44,844,802円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジなし／資産成長型）	651,345,414円	574,878,846円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／資産成長型）	351,073,009円	651,326,783円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	301,604,602円	350,726,914円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	383,107,917円	459,562,052円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	558,687,041 円	708,970,209 円
グローバルＲＥＩＴファンド 2021-07（適格機関投資家専用）	881,939,728 円	832,945,758 円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	223,818,670 円	222,715,768 円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）	18,404,155 円	18,862,214 円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	21,797,734 円	25,299,838 円
計	27,937,030,793 円	26,103,872,416 円
2. 期末日における受益権の総数	27,937,030,793 口	26,103,872,416 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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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	2023 年 1 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1月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	4,763,705,784	△4,008,201,930
合計	4,763,705,784	△4,008,201,930

（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（2021年9月16日から2022年1月11日まで、及び2022年9月16日から2023年1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1月11日 現在				2023年1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	－	－	－	－	62,414,829	－	62,410,988	3,841
ユーロ	－	－	－	－	62,414,829	－	62,410,988	3,841
買　建	－	－	－	－	62,414,829	－	62,530,028	115,199
アメリカ・ドル	－	－	－	－	62,414,829	－	62,530,028	115,199
合計	－	－	－	－	124,829,658	－	124,941,016	119,040

（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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.7522円 (37,522円)	3.4017円 (34,017円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	167,160	19,778,371.200	
		EQUINIX INC	20,955	14,273,707.800	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	401,683	6,507,264.600	
		KIMCO REALTY CORP	423,095	8,923,073.550	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	499,757	10,379,952.890	
		INVITATION HOMES INC	736,461	21,946,537.800	
		AMERICOLD REALTY TRUST	361,289	10,437,639.210	
		VICI PROPERTIES INC	39,758	1,271,460.840	
		APARTMENT INCOME REIT CO	143,284	4,999,178.760	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	112,864	6,333,927.680	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	7,127,756	4,205,376.040	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	146,044	5,904,558.920	
		SUN COMMUNITIES INC	86,146	12,386,071.880	
		PROLOGIS INC	269,163	31,239,057.780	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	91,816	10,376,126.160	
		COUSINS PROPERTIES INC	200,632	4,843,256.480	
		SITE CENTERS CORP	126,095	1,632,930.250	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,913	2,107,206.410	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	65,418	3,193,706.760	
		WELLTOWER INC	455,438	31,548,190.260	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,480	1,352,379.600	

	HIGHWOODS PROPERTIES INC	109,582	3,059,529.440	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	92,486	14,405,619.360	
	REALTY INCOME CORP	383,173	24,791,293.100	
	PUBLIC STORAGE	64,430	18,118,360.300	
	UDR INC	264,885	10,190,125.950	
	AGREE REALTY CORP	47,676	3,438,393.120	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	233,707	23,637,125.980	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	60,269	8,877,623.700	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 320,158,045.820 (42,212,838,342)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD	1,541,074	1,964,869.350	
	ASSURA PLC	9,434,729	5,292,882.960	
	LXI REIT PLC	3,287,157	3,799,953.490	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,740,264	2,366,759.040	
	SEGRO PLC	1,082,927	8,715,396.490	
	UNITE GROUP PLC/THE	578,790	5,437,732.050	
	BRITISH LAND CO PLC	3,044,475	12,482,347.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1,064,153	5,655,973.190	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	707,854	6,841,408.910	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,130,642	3,826,633.030	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,739,205	4,059,501.810	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 60,443,457.820 (9,699,361,676)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	1,699,564	13,188,616.640	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	4,209,541	7,387,744.450	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,475,616	12,539,160.640	
	MIRVAC GROUP	4,341,128	9,376,836.480	
	STOCKLAND	3,680,286	13,396,241.040	
	GOODMAN GROUP	2,553,296	45,448,668.800	
	CHARTER HALL GROUP	2,451,604	29,860,536.720	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,345,619	15,021,829.310	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 146,219,634.080 (13,320,608,665)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	916,877	19,877,893.360	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 19,877,893.360 (1,956,382,265)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	11,282,200	13,538,640.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	8,716,100	24,143,597.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	4,446,300	4,624,152.000	

		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,691,477	21,286,123.980	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 63,592,512.980 (6,298,202,485)	
	ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	5,190,882	ニュージーランド・ドル 10,563,444.870	
	ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 10,563,444.870 (887,329,370)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	233,074	ユーロ 5,570,468.600	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	101,975	5,541,321.500	
		ICADE	118,734	5,264,665.560	
		ARGAN	37,204	2,980,040.400	
		KLEPIERRE	540,374	12,342,142.160	
		COVIVIO	94,995	5,599,955.250	
		MERCIALYS	271,872	2,797,562.880	
		AEDIFICA	53,758	4,303,327.900	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	226,463	6,390,785.860	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	697,528	6,232,412.680	
	ユーロ　小計			ユーロ 57,022,682.790 (8,061,866,893)	
	香港・ドル	LINK REIT	3,035,092	香港・ドル 179,677,446.400	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 179,677,446.400 (3,034,752,069)	
投資証券　合計				85,471,341,765 [85,471,341,765]	
合計				85,471,341,765 [85,471,341,765]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数		組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	29 銘柄	100%	49.4%
イギリス・ポンド	投資証券	11 銘柄	100%	11.3%
オーストラリア・ドル	投資証券	8 銘柄	100%	15.6%
カナダ・ドル	投資証券	1 銘柄	100%	2.3%
シンガポール・ドル	投資証券	4 銘柄	100%	7.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券	1 銘柄	100%	1.0%
ユーロ	投資証券	10 銘柄	100%	9.4%
香港・ドル	投資証券	1 銘柄	100%	3.6%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年1月11日現在 金　額（円）	2023年1月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,623,815,473	2,766,010,842
投資証券　※2	124,284,274,600	137,648,483,600
未収入金	552,548,296	657,999,915
未収配当金	736,507,341	1,036,728,049
前払金	－	105,212,400
流動資産合計	128,197,145,710	142,214,434,806
資産合計	128,197,145,710	142,214,434,806
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,932,000	87,155,400
前受金	4,800,000	－
未払金	619,709,383	471,736,274
未払解約金	29,266,000	12,697,000
流動負債合計	658,707,383	571,588,674
負債合計	658,707,383	571,588,674
純資産の部		
元本等		
元本　※1	36,668,053,622	42,460,993,574
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	90,870,384,705	99,181,852,558
元本等合計	127,538,438,327	141,642,846,132
純資産合計	127,538,438,327	141,642,846,132
負債純資産合計	128,197,145,710	142,214,434,806

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1月12日 至　2023年1月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	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、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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	32,599,135,387円	36,668,053,622円
期中追加設定元本額	5,787,582,584円	6,531,084,834円
期中一部解約元本額	1,718,664,349円	738,144,882円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	33,868,187,627円	39,552,450,503円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,351,880円	9,974,369円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,888,987円	8,333,819円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	43,937,390円	41,696,345円
６資産バランスファンド（分配型）	85,144,047円	73,760,418円

	６資産バランスファンド（成長型）	226,955,404 円	212,258,656 円
	世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	23,688,636 円	21,134,370 円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	26,469,712 円	24,178,392 円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	315,250,826 円	349,951,698 円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	401,490,597 円	457,604,313 円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	588,220,067 円	702,833,671 円
	ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	298,157,653 円	250,736,107 円
	ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	62,345,842 円	53,562,973 円
	ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	20,683,514 円	18,604,861 円
	ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	98,365,944 円	90,988,033 円
	ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年４回決算型）	590,915,496 円	592,925,046 円
計		36,668,053,622 円	42,460,993,574 円
2.	期末日における受益権の総数	36,668,053,622 口	42,460,993,574 口
3. ※2	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,109,100,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　982,100,000 円

（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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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を目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2023年1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1月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△2,313,461,157	△6,969,619,134
合計	△2,313,461,157	△6,969,619,134

（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（2021年11月11日から2022年1月11日まで、及び2022年11月11日から2023年1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

不動産投信関連

	2022年1月11日 現在	2023年1月10日 現在

種　類	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 不動産投信指数先物取引 買　建	2,401,800,000	－	2,397,000,000	△4,800,000	2,480,312,400	－	2,393,300,000	△87,012,400
合計	2,401,800,000	－	2,397,000,000	△4,800,000	2,480,312,400	－	2,393,300,000	△87,012,400

（注）1. 時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4782円 (34,782円)	3.3358円 (33,358円)

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	2,176	257,638,400	
	サンケイリアルエステート	12,057	1,059,810,300	
	SOSILA物流リート投	3,826	512,684,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	5,696	3,394,816,000	
	森ヒルズリート	11,169	1,722,259,800	
	産業ファンド	19,790	2,913,088,000	
	アドバンス・レジデンス	13,607	4,578,755,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	26,561	5,367,978,100	
	ＡＰＩ投資法人	5,754	2,336,124,000	
	ＧＬＰ投資法人	63,909	9,254,023,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	8,594	2,498,275,800	
	日本プロロジスリート	25,222	7,591,822,000	
	ＯＮＥリート投資法人	4,172	1,016,299,200	

	イオンリート投資	24,002	3,614,701,200	
	ヒューリックリート投資法	15,335	2,445,932,500	
	日本リート投資法人	7,215	2,445,885,000	
	積水ハウス・リート投資	41,631	3,089,020,200	
	ケネディクス商業リート	12,761	3,148,138,700	
	野村不動産マスターＦ	42,020	6,626,554,000	
	ラサールロジポート投資	29,507	4,600,141,300	
	スターアジア不動産投	24,633	1,335,108,600	
	三井不ロジパーク	9,006	4,205,802,000	
	三菱地所物流 REIT	10,366	4,286,341,000	
	CRE ロジスティクスファンド	1,445	261,978,500	
	ザイマックス・リート	2,690	314,730,000	
	タカラレーベン不動産投	2,304	226,252,800	
	日本ビルファンド	19,958	11,635,514,000	※
	ジャパンリアルエステイト	9,190	5,275,060,000	※
	日本都市ファンド投資法人	54,998	5,703,292,600	
	オリックス不動産投資	21,290	3,810,910,000	
	日本プライムリアルティ	13,124	4,731,202,000	
	NTT 都市開発リート投資法人	9,251	1,256,285,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人	4,576	489,632,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	28,713	4,312,692,600	
	森トラスト総合リート	936	135,064,800	
	インヴィンシブル投資法人	62,828	3,254,490,400	
	フロンティア不動産投資	4,005	2,010,510,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,130	348,605,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	12,461	3,931,445,500	
	大和証券オフィス投資法人	2,680	1,669,640,000	
	阪急阪神リート投資法人	3,364	495,180,800	
	大和ハウスリート投資法人	24,334	6,957,090,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	24,169	1,875,514,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	4,990	652,193,000	
投資証券　合計			137,648,483,600	
合計			137,648,483,600	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　700 口　ジャパンリアルエステイト　1,000 口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ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1月11日現在 金　額（円）	2023年1月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	119,165,866	283,932,737
コール・ローン	107,651,650	48,444,778
株式	3,305,389,954	3,280,942,811
ハイブリッド優先証券	699,149,936	1,013,821,558
投資証券	21,818,440	30,629,157
未収入金	38,024,577	32,264,033
未収配当金	3,137,088	4,395,222
未収利息	1,149,546	3,952,092
流動資産合計	4,295,487,057	4,698,382,388
資産合計	4,295,487,057	4,698,382,388
負債の部		
流動負債		
未払金	45,718,442	106,915,986
未払解約金	6,188,000	－
流動負債合計	51,906,442	106,915,986
負債合計	51,906,442	106,915,986
純資産の部		
元本等		
元本　※1	941,474,515	1,041,508,142
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,302,106,100	3,549,958,260
元本等合計	4,243,580,615	4,591,466,402
純資産合計	4,243,580,615	4,591,466,402
負債純資産合計	4,295,487,057	4,698,382,388

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1月12日 至　2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1. ※1 期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	946,303,989円	941,474,515円
期中追加設定元本額	83,286,473円	143,771,419円
期中一部解約元本額	88,115,947円	43,737,792円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,818,265円	5,327,449円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,572,820円	4,361,590円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	80,684,731円	73,878,680円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	12,471,342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）	13,707,913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）	129,184,441円	138,629,610円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	246,321,189円	272,054,012円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	449,713,814 円	523,508,691 円
計	941,474,515 円	1,041,508,142 円
2. 期末日における受益権の総数	941,474,515 口	1,041,508,142 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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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	2023 年 1 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

	2022 年 1 月 11 日現在	2023 年 1 月 10 日現在

種　類	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	166,965,893	283,484,640
ハイブリッド優先証券	△15,946,186	50,486,504
投資証券	△81,429	657,496
合計	150,938,278	334,628,640

（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（2021年10月16日から2022年1月11日まで、及び2022年10月18日から2023年1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1月11日現在	2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.5074円 (45,074円)	4.4085円 (44,085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	112.150	118,991.150	
	ADOBE INC	1,651	341.980	564,608.980	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,317	86.000	199,262.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	889	311.670	277,074.630	
	CITIGROUP INC	3,318	47.540	157,737.720	
	DANAHER CORP	954	255.050	243,317.700	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,525	105.240	370,971.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,727	85.370	147,433.990	
	APPLE INC	11,002	130.150	1,431,910.300	
	BOEING CO/THE	1,296	208.570	270,306.720	
	NISOURCE INC	5,984	27.880	166,833.920	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,858	48.140	185,724.120	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	13,129	41.370	543,146.730	
	JPMORGAN CHASE & CO	4,590	137.370	630,528.300	
	CATERPILLAR INC	781	246.620	192,610.220	
	MORGAN STANLEY	3,553	87.640	311,384.920	
	BROADCOM INC	1,541	576.890	888,987.490	
	DEERE & CO	749	428.200	320,721.800	
	TELEFLEX INC	971	257.150	249,692.650	

	COLGATE-PALMOLIVE CO	2,201	78.730	173,284.730	
	COSTCO WHOLESALE CORP	697	478.750	333,688.750	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	2,070	141.490	292,884.300	
	CSX CORP	6,262	32.140	201,260.680	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,340	243.450	326,223.000	
	AMAZON.COM INC	6,283	87.360	548,882.880	
	EXXON MOBIL CORP	2,487	108.470	269,764.890	
	FORD MOTOR CO	10,276	12.690	130,402.440	
	NEXTERA ENERGY INC	2,871	84.070	241,364.970	
	FREEPORT-MCMORAN INC	4,376	42.830	187,424.080	
	GENERAL MOTORS CO	3,982	35.920	143,033.440	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,164	353.000	410,892.000	
	ALPHABET INC-CL A	5,329	88.020	469,058.580	
	HOME DEPOT INC	839	317.810	266,642.590	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,033	143.550	291,837.150	
	JOHNSON & JOHNSON	3,056	175.580	536,572.480	
	KLA CORP	859	408.330	350,755.470	
	MCDONALD'S CORP	1,872	267.250	500,292.000	
	META PLATFORMS INC CLASS A	3,691	129.470	477,873.770	
	PHILLIPS 66	3,130	102.010	319,291.300	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,362	260.610	354,950.820	
	MERCK & CO. INC.	2,148	110.380	237,096.240	
	NIKE INC -CL B	2,936	124.850	366,559.600	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	1,159	254.230	294,652.570	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	495	495.410	245,227.950	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,630	102.300	269,049.000	
	EVERGY INC	3,649	64.280	234,557.720	
	PFIZER INC	2,215	48.390	107,183.850	
	DOW INC	2,377	55.280	131,400.560	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,829	152.040	430,121.160	
	PEPSICO INC	1,414	179.330	253,572.620	
	TESLA INC	1,608	119.770	192,590.160	
	AT&T INC	7,958	19.040	151,520.320	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,788	181.690	324,861.720	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	865	490.060	423,901.900	
	ELEVANCE HEALTH INC	784	470.710	369,036.640	
	WALT DISNEY CO/THE	3,022	94.770	286,394.940	
	WALMART INC	1,403	144.950	203,364.850	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,403	255.060	357,849.180	
	VISA INC-CLASS A SHARES	1,426	218.600	311,723.600	
	NVIDIA CORP	1,553	156.280	242,702.840	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	670	164.280	110,067.600	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	626	546.090	341,852.340	
	MASTERCARD INC - A	820	370.970	304,195.400	
	ONEOK INC	3,841	67.690	259,997.290	
	BANK OF AMERICA CORP	14,012	33.890	474,866.680	
	ADVANCED MICRO DEVICES	1,993	67.240	134,009.320	

	EATON CORP PLC	2,066	160.880	332,378.080	
	BARRICK GOLD CORP	15,819	18.970	300,086.430	
	CARDINAL HEALTH INC	4,181	77.570	324,320.170	
	INTEL CORP	3,172	29.310	92,971.320	
	TARGET CORP	1,561	156.350	244,062.350	
	MICROSOFT CORP	6,173	227.120	1,402,011.760	
	MEDTRONIC PLC	3,262	77.540	252,935.480	
	CHUBB LTD	825	223.510	184,395.750	
	COMCAST CORP-CLASS A	4,333	37.550	162,704.150	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 24,451,846.200 (3,223,975,923)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	8,853	42.190	373,508.070	
	ENBRIDGE INC	3,741	54.880	205,306.080	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 578,814.150 (56,966,888)	
合計				3,280,942,811 [3,280,942,811]	

(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	139,783.930	
		CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	720.000	17,805.600	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	608.000	14,640.640	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	1,933.000	46,913.910	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6,877.000	143,660.530	
		NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	4,388.000	102,898.600	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	8,430.000	179,643.300	
		VALLEY NATIONAL BANCORP FR	2,297.000	57,769.550	
		ENBRIDGE INC 6.375 B	1,438.000	35,202.240	
		BANK OF AMERICA CORP 6 GG	3,240.000	81,032.400	
		BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	2,603.000	63,981.740	
		AT&T INC 5.625	6,582.000	159,021.120	
		JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	3,116.000	77,183.320	
		NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	70,655.200	
		JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	3,131.000	80,122.290	
		CITIZENS FINANCIAL GROUP 6.35 D	9,556.000	237,945.350	
		CMS ENERGY CORP 5.875	12,484.000	298,501.170	
		REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,390.000	32,748.400	
		ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	9,830.000	223,632.500	
		ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100.000	25,960.000	

		BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	2,662.000	59,788.520	
		SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	2,676.000	63,849.360	
		ALLSTATE CORP 5.1 H	4,777.000	104,472.990	
		SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	152,486.600	
		FIFTH THIRD BANCORP 6 A	10,855.000	259,760.150	
		BANK OF AMERICA CORP 5 LL	1,588.000	33,475.040	
		FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	7,241.000	145,760.600	
		SOUTHERN CO 4.95 2020	764.000	16,265.560	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	13,547.000	268,772.480	
		FIRST HORIZON CORP 6.5	10,027.000	250,675.000	
		ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	8,532.000	214,494.480	
		TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	4,159.000	86,424.020	
		UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1,403.000	26,502.670	
		FIRST REPUBLIC BANK 4.125 K	7,300.000	127,093.000	
		BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167.000	53,585.640	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	9,717.000	192,882.450	
		BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	12,288.000	217,866.240	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	11,331.000	207,583.920	
		FIRST REPUBLIC BANK 4.25 L	9,315.000	167,949.450	
		WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	4,812.000	91,572.360	
		FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10,983.000	271,609.590	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12,600.000	253,764.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	8,403.000	171,001.050	
		KEMPER CORP FR	6,360.000	130,952.400	
		WESCO INTERNATIONAL INC FR	5,224.000	141,309.200	
		WTFNL FR	6,744.000	173,590.560	
		PACWL FR	1,881.000	48,153.600	
		MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	4,785.000	122,974.500	
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	1,269.000	31,407.750	
		KEY FR	1,258.000	31,185.820	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	2,628.000	50,510.160	
		RGA FR	12,175.000	317,402.250	
		AQNCN FR	7,125.000	171,570.000	
		LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4,900.000	137,445.000	
		ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I	3,250.000	82,745.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J	1,315.000	32,848.700	

		FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	649.000	16,367.780	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589.000	40,376.490	
		REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	3,790.000	96,569.200	
		WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1,290.000	32,972.400	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	6,563.000	169,128.510	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	3,996.000	100,219.680	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3,258.000	78,126.840	
		CITIGROUP INC 7.125 J	6,132.000	156,611.280	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 7,689,204.080 (1,013,821,558)	
ハイブリッド優先証券　合計				1,013,821,558 [1,013,821,558]	
投資証券	アメリカ・ドル	DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7,569	アメリカ・ドル 153,650.700	
		PUBLIC STORAGE 4.625 L	3,915	78,652.350	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 232,303.050 (30,629,157)	
投資証券　合計				30,629,157 [30,629,157]	
合計				1,044,450,715 [1,044,450,715]	

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）　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。

1.
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　75銘柄 ハイブリッド優先証券　64銘柄 投資証券　2銘柄	75.5%	23.8%	0.7%	98.7%
カナダ・ドル	株式　2銘柄	100%	-%	-%	1.3%

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1月11日現在	2023年1月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	9,859,949	59,663,990
コール・ローン	4,208,292	14,658,568
株式	1,457,201,636	1,482,417,795
未収配当金	2,045,878	2,087,458
流動資産合計	1,473,315,755	1,558,827,811
資産合計	1,473,315,755	1,558,827,811
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,540,000	－
流動負債合計	2,540,000	－
負債合計	2,540,000	－
純資産の部		
元本等		
元本　※1	671,590,671	683,447,022
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	799,185,084	875,380,789
元本等合計	1,470,775,755	1,558,827,811
純資産合計	1,470,775,755	1,558,827,811
負債純資産合計	1,473,315,755	1,558,827,811

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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	740,519,917円	671,590,671円
期中追加設定元本額	53,140,381円	89,094,907円
期中一部解約元本額	122,069,627円	77,238,556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）	10,025,550円	10,569,177円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,425,055円	8,655,042円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	167,318,233円	151,100,386円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	25,991,297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）	28,464,799円	24,865,274円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	67,165,600円	68,720,962円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	128,098,349円	134,800,822円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	235,101,788円	259,462,979円
計	671,590,671円	683,447,022円
2.　期末日における受益権の総数	671,590,671口	683,447,022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1月12日 至　2023年1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	2023年1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1月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	75,913,591	184,293,240
合計	75,913,591	184,293,240

（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（2021年10月16日から2022年1月11日まで、及び2022年10月18日から2023年1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1月11日現在	2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1900円 (21,900円)	2.2808円 (22,808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	23.790	295,186.320	
	UNILEVER PLC	4,736	41.950	198,675.200	
	PRUDENTIAL PLC	15,660	12.470	195,280.200	
	AVIVA PLC	32,608	4.550	148,366.400	
	GSK	13,419	14.214	190,737.660	
	M&G PLC	72,546	1.942	140,920.600	
	TESCO PLC	93,308	2.432	226,925.050	
	VODAFONE GROUP PLC	107,247	0.886	95,117.360	
	NATIONAL GRID PLC	18,856	10.375	195,631.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	45,791	5.632	257,894.910	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 1,944,734.700 (312,071,577)	
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	291.400	403,589.000	
	NESTLE SA-REG	5,885	111.620	656,883.700	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	953	449.800	428,659.400	
	NOVARTIS AG-REG	4,630	85.310	394,985.300	
	GIVAUDAN-REG	81	3,023.000	244,863.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 2,128,980.400 (304,529,357)	
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	163.320	428,388.360	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 428,388.360 (5,423,397)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,954	138.340	408,656.360	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,161	89.980	284,426.780	
	BASF SE	3,878	52.840	204,913.520	
	ALLIANZ SE-REG	1,208	213.650	258,089.200	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,094	324.300	354,784.200	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	22,308	19.856	442,947.640	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,287	37.845	237,931.510	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,864	27.655	189,823.920	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,845	120.500	222,322.500	
	KONINKLIJKE KPN NV	92,764	3.003	278,570.290	
	TOTALENERGIES SE	6,645	58.320	387,536.400	
	MICHELIN (CGDE)	9,094	29.235	265,863.090	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,865	144.820	414,909.300	
	BNP PARIBAS	4,209	59.020	248,415.180	
	CAPGEMINI SE	1,845	166.800	307,746.000	
	AXA SA	12,793	27.405	350,592.160	
	SANOFI	4,107	90.440	371,437.080	
	INTESA SANPAOLO	106,084	2.228	236,408.190	
	ENI SPA	13,646	13.944	190,279.820	
	ENEL SPA	50,801	5.599	284,434.790	

	ENAGAS SA	9,015	16.150	145,592.250	
ユーロ　小計				ユーロ 6,085,680.180 (860,393,464)	
合計				1,482,417,795 [1,482,417,795]	

(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	10 銘柄	100%	21.1%
スイス・フラン	株式	5 銘柄	100%	20.5%
スウェーデン・クローナ	株式	1 銘柄	100%	0.4%
ユーロ	株式	21 銘柄	100%	58.0%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年1月11日現在	2023年1月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	21,998,692	22,909,593
コール・ローン	8,335,979	4,562,506
株式	668,759,575	670,513,894
未収配当金	235,509	262,670
流動資産合計	699,329,755	698,248,663
資産合計	699,329,755	698,248,663
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,812,000	－
流動負債合計	5,812,000	－
負債合計	5,812,000	－
純資産の部		
元本等		
元本　※1	233,981,686	236,240,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	459,536,069	462,008,144
元本等合計	693,517,755	698,248,663
純資産合計	693,517,755	698,248,663
負債純資産合計	699,329,755	698,248,663

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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	281,837,347円	233,981,686円
期中追加設定元本額	18,095,870円	29,453,129円
期中一部解約元本額	65,951,531円	27,194,296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）	7,542,994円	7,897,395円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,116,298円	6,488,884円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	124,105,017円	115,797,057円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	19,317,654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）	21,002,510円	18,966,039円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	8,505,757円	10,032,864円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	16,368,771円	19,730,643円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	30,022,685円	37,914,155円
計	233,981,686円	236,240,519円
2.　期末日における受益権の総数	233,981,686口	236,240,519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1月12日 至　2023年1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	2023年1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1月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年1月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	36,310,917	62,583,652
合計	36,310,917	62,583,652

（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（2021年10月16日から2022年1月11日まで、及び2022年10月18日から2023年1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1月11日現在	2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9640円 (29,640円)	2.9557円 (29,557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	6,750	48.000	324,000.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,978	35.040	209,469.120	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,000	30.000	210,000.000	
	WESTPAC BANKING CORP	10,100	23.370	236,037.000	
	SANTOS LTD	19,134	7.110	136,042.740	
	RIO TINTO LTD	700	118.780	83,146.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,500	103.320	258,300.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,080	174.100	188,028.000	
	CSL LTD	820	277.000	227,140.000	
	WESFARMERS LTD	4,930	47.330	233,336.900	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 2,105,499.760 (191,811,028)	
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	3.730	159,644.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	10,500	30.670	322,035.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,300	35.250	186,825.000	
	SHENG SIONG GROUP LTD	93,500	1.670	156,145.000	
	KEPPEL CORP LTD	9,500	7.310	69,445.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	46,600	2.510	116,966.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	4.170	70,890.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 1,081,950.000 (107,156,328)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA CORP	400	64,100.000	25,640,000.000	
	SK HYNIX INC	2,000	86,000.000	172,000,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	200	164,000.000	32,800,000.000	
	SAMSUNG SDI CO LTD	90	600,000.000	54,000,000.000	
	NAVER CORP	190	196,500.000	37,335,000.000	
	LG CHEM LTD	50	624,000.000	31,200,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,350	57,200.000	77,220,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,010	60,700.000	425,507,000.000	
	SK TELECOM	1,147	47,500.000	54,482,500.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	1,950	48,650.000	94,867,500.000	
韓国・ウォン　小計				韓国・ウォン 1,005,052,000.000 (106,736,522)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	85,000	4.240	360,400.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	8,000	60.000	480,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,600	377.400	981,240.000	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	23,000	8.220	189,060.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	80,000	5.000	400,000.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,000	41.550	332,400.000	
	AIA GROUP LTD	28,000	87.300	2,444,400.000	

	SANDS CHINA LTD	20,800	28.000	582,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	2,500	93.650	234,125.000	
	LI NING CO LTD	6,000	72.300	433,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	35,500	27.450	974,475.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	5,500	46.850	257,675.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 7,669,975.000 (129,545,878)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	DELTA ELECTRONICS INC	3,000	283.000	849,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	56.700	567,000.000	
	MEDIATEK INC	3,000	675.000	2,025,000.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	134,000	23.150	3,102,100.000	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	69,260	27.000	1,870,020.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	348.500	1,394,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	14,000	231.000	3,234,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	28,000	481.000	13,468,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	23,000	99.100	2,279,300.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	57,000	44.500	2,536,500.000	
台湾・ドル　小計				台湾・ドル 31,324,920.000 (135,264,138)	
合計				670,513,894 [670,513,894]	

(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%	28.6%
シンガポール・ドル	株式　7 銘柄	100%	16.0%
韓国・ウォン	株式　10 銘柄	100%	15.9%
香港・ドル	株式　12 銘柄	100%	19.3%
台湾・ドル	株式　10 銘柄	100%	20.2%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ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1月11日現在	2023年1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	753,646,477	853,766,767
株式	15,474,691,330	15,667,612,640
未収入金	13,255,239	33,211,300
未収配当金	27,801,500	21,482,225
流動資産合計	16,269,394,546	16,576,072,932
資産合計	16,269,394,546	16,576,072,932
負債の部		
流動負債		
未払金	92,739,590	69,064,952
未払解約金	28,201,000	11,207,000
流動負債合計	120,940,590	80,271,952
負債合計	120,940,590	80,271,952
純資産の部		
元本等		
元本　※1	4,588,117,450	4,640,307,388
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,560,336,506	11,855,493,592
元本等合計	16,148,453,956	16,495,800,980
純資産合計	16,148,453,956	16,495,800,980
負債純資産合計	16,269,394,546	16,576,072,932

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年1月12日 至　2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1.　※1　期首	2021年1月13日	2022年1月12日
期首元本額	5,432,945,076円	4,588,117,450円
期中追加設定元本額	378,056,423円	494,623,440円
期中一部解約元本額	1,222,884,049円	442,433,502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）	2,729,191,047円	2,717,853,184円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	23,356,273円	21,660,400円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,555,722円	19,298,272円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	18,175,845円	16,506,058円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	316,475,131円	280,462,556円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	49,514,385円	44,893,736円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	53,853,011円	46,259,114円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	214,965,887円	221,786,367円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	410,404,198 円	436,012,950 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	752,625,951 円	835,574,751 円
計	4,588,117,450 円	4,640,307,388 円
2. 期末日における受益権の総数	4,588,117,450 口	4,640,307,388 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 1 月 12 日 至　2023 年 1 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	2023 年 1 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 1 月 11 日現在	2023 年 1 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	404,139,256	25,464,405
合計	404,139,256	25,464,405

（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（2021年10月16日から2022年1月11日まで、及び2022年10月18日から2023年1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1月11日現在	2023年1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1月11日現在	2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.5196円 (35,196円)	3.5549円 (35,549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	283.00	83,315,200	
大和ハウス	34,400	3,008.00	103,475,200	
ブルボン	22,400	2,105.00	47,152,000	
ディップ	12,800	3,605.00	46,144,000	
アサヒグループホールディン	47,800	4,057.00	193,924,600	
エレマテック	21,700	1,527.00	33,135,900	
パルグループＨＬＤＧＳ	72,900	2,543.00	185,384,700	
太陽化学	22,300	1,468.00	32,736,400	
富士紡ホールディングス	9,800	3,155.00	30,919,000	
ダイワボウＨＤ	129,600	1,905.00	246,888,000	
トヨタ紡織	37,400	1,776.00	66,422,400	
レスターホールディングス	11,100	2,038.00	22,621,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	36,300	844.00	30,637,200	
三洋貿易	84,000	1,084.00	91,056,000	
東急不動産ＨＤ	88,900	632.00	56,184,800	
東　レ	508,400	737.50	374,945,000	
ＡＮＤ　ＤＯホールディングス	46,800	780.00	36,504,000	
コメダホールディングス	16,000	2,399.00	38,384,000	
共和レザー	64,400	498.00	32,071,200	
セーレン	22,700	2,340.00	53,118,000	
ワコールホールディングス	8,900	2,364.00	21,039,600	
ＳＲＡホールディングス	7,500	2,960.00	22,200,000	
レンゴー	36,600	888.00	32,500,800	
日本曹達	36,800	4,085.00	150,328,000	
東亜合成	67,400	1,108.00	74,679,200	
大阪ソーダ	34,100	3,825.00	130,432,500	
信越化学	13,600	16,660.00	226,576,000	

東京応化工業	10,900	6,180.00	67,362,000	
住友ベークライト	22,800	3,920.00	89,376,000	
旭有機材	23,100	2,724.00	62,924,400	
電通グループ	45,700	4,100.00	187,370,000	
アステラス製薬	176,500	1,901.50	335,614,750	
日本空調サービス	74,600	677.00	50,504,200	
フルキャストホールディングス	33,000	2,619.00	86,427,000	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	43,200	6,583.00	284,385,600	
デクセリアルズ	49,700	2,591.00	128,772,700	
ＡＧＣ	58,200	4,550.00	264,810,000	
日本製鉄	72,900	2,368.00	172,627,200	
大和工業	15,800	4,505.00	71,179,000	
昭和電線ＨＬＤＧＳ	53,200	1,738.00	92,461,600	
アサヒＨＤ	40,300	1,943.00	78,302,900	
三和ホールディングス	63,200	1,208.00	76,345,600	
日東精工	77,400	485.00	37,539,000	
マルゼン	30,900	1,800.00	55,620,000	
ファインシンター	17,800	1,029.00	18,316,200	
ツ　ガ　ミ	95,500	1,218.00	116,319,000	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	93,300	1,331.00	124,182,300	
豊田自動織機	6,700	7,340.00	49,178,000	
フリュー	45,400	1,039.00	47,170,600	
小松製作所	110,700	2,851.00	315,605,700	
三精テクノロジーズ	28,500	783.00	22,315,500	
日　立	74,400	6,517.00	484,864,800	
富士電機	57,100	5,180.00	295,778,000	
ダイヘン	11,600	3,920.00	45,472,000	
ＩＤＥＣ	39,500	2,805.00	110,797,500	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	57,900	4,330.00	250,707,000	
デンソー	34,200	6,545.00	223,839,000	
京　セ　ラ	4,400	6,506.00	28,626,400	
村田製作所	6,300	6,962.00	43,860,600	
ＩＨＩ	67,800	3,660.00	248,148,000	
プレミアグループ	78,100	1,600.00	124,960,000	
いすゞ自動車	172,600	1,524.00	263,042,400	
トヨタ自動車	127,900	1,827.00	233,673,300	
プレス工業	116,000	418.00	48,488,000	
ミクニ	67,400	323.00	21,770,200	
豊田合成	114,900	2,029.00	233,132,100	
第一興商	12,500	3,850.00	48,125,000	
萩原電気ＨＬＤＧＳ	17,300	2,402.00	41,554,600	
ダイトロン	42,500	2,242.00	95,285,000	
スター精密	21,800	1,587.00	34,596,600	
信越ポリマー	63,800	1,133.00	72,285,400	
伊　藤　忠	127,800	4,019.00	513,628,200	
東京エレクトロン	9,800	42,440.00	415,912,000	
スターゼン	20,800	2,045.00	42,536,000	
セイコーグループ	38,900	2,970.00	115,533,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	131,400	3,225.00	423,765,000	

三菱商事	72,500	4,226.00	306,385,000	
阪和興業	16,600	3,670.00	60,922,000	
稲畑産業	7,100	2,372.00	16,841,200	
丸井グループ	69,900	2,131.00	148,956,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	867,700	893.30	775,116,410	
りそなホールディングス	261,700	707.90	185,257,430	
三井住友トラストＨＤ	104,600	4,556.00	476,557,600	
ＳＢＩホールディングス	35,600	2,559.00	91,100,400	
オリックス	151,800	2,097.00	318,324,600	
ＭＳ＆ＡＤ	54,200	4,131.00	223,900,200	
第一生命ＨＬＤＧＳ	116,300	2,873.50	334,188,050	
東京海上ＨＤ	250,000	2,738.50	684,625,000	
三井不動産	51,100	2,354.00	120,289,400	
東京建物	40,700	1,562.00	63,573,400	
丸全昭和運輸	13,800	2,965.00	40,917,000	
九州旅客鉄道	34,200	2,831.00	96,820,200	
三井倉庫ＨＯＬＤ	38,200	3,540.00	135,228,000	
上　組	106,200	2,603.00	276,438,600	
日本電信電話	155,800	3,696.00	575,836,800	
ＫＤＤＩ	67,900	3,921.00	266,235,900	
光通信	9,600	17,810.00	170,976,000	
関西電力	162,100	1,219.00	197,599,900	
大阪瓦斯	119,100	2,020.00	240,582,000	
日本管財	5,900	2,462.00	14,525,800	
サンドラッグ	23,000	3,850.00	88,550,000	
合計			15,667,612,640	

(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。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2022年1月12日から2023年1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3月3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ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）の2022年1月12日から2023年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）の2023年1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計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、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】

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）

(1)　【貸借対照表】

	第16期 2022年1月11日現在 金　額（円）	第17期 2023年1月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,687,968	140,338,341
親投資信託受益証券	8,526,809,928	9,317,155,790
未収入金	10,341,000	7,828,000
流動資産合計	8,663,838,896	9,465,322,131
資産合計	8,663,838,896	9,465,322,131
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,100,252	11,212,138
未払受託者報酬	2,256,168	2,614,558
未払委託者報酬	45,124,336	52,292,037
その他未払費用	338,341	392,101
流動負債合計	59,819,097	66,510,834
負債合計	59,819,097	66,510,834
純資産の部		
元本等		
元本　※1	3,918,064,052	4,475,748,849
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,685,955,747	4,923,062,448
（分配準備積立金）	1,889,853,969	1,730,775,163
元本等合計	8,604,019,799	9,398,811,297
純資産合計	8,604,019,799	9,398,811,297
負債純資産合計	8,663,838,896	9,465,322,131

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第17期 自 2022年1月12日 至 2023年1月10日
	金　額（円）	金　額（円）
営業収益		
受取利息	21	13
有価証券売買等損益	1,209,920,837	△309,372,138
営業収益合計	1,209,920,858	△309,372,125
営業費用		
支払利息	23,995	36,142
受託者報酬	4,203,307	5,009,162
委託者報酬 ※1	84,067,824	100,185,197
その他費用	630,370	751,204
営業費用合計	88,925,496	105,981,705
営業利益又は営業損失（△）	1,120,995,362	△415,353,830
経常利益又は経常損失（△）	1,120,995,362	△415,353,830
当期純利益又は当期純損失（△）	1,120,995,362	△415,353,830
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	76,305,044	△9,132,218
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,040,953,802	4,685,955,747
剰余金増加額又は欠損金減少額	989,062,102	1,082,697,821
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	989,062,102	1,082,697,821
剰余金減少額又は欠損金増加額	388,750,475	439,369,508
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	388,750,475	439,369,508
分配金 ※2	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,685,955,747	4,923,062,448

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2022年1月10日が休日のため、前計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1.　※1　期首元本額	3,443,846,915円	3,918,064,052円
期中追加設定元本額	906,065,649円	926,048,289円
期中一部解約元本額	431,848,512円	368,363,492円
2.　計算期間末日における受益権の総数	3,918,064,052口	4,475,748,849口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第16期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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	12,533,552円	14,771,639円
2.　※2　分配金の計算過程	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（0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（1,044,691,555円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,078,586,002円）及び	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（0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（3,944,856,254円）及び分配準備積立金

	分配準備積立金 （845,162,414円）より分配可能額は4,968,439,971円（1万口当たり12,680.85円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	（1,730,775,163円）より分配可能額は5,675,631,417円（1万口当たり12,680.85円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。

（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	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
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	第17期 2023年1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	第16期 2022年1月11日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第17期 2023年1月10日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,165,088,609	△311,751,348
合計	1,165,088,609	△311,751,348

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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）

	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1960円 (21,960円)	2.0999円 (20,999円)

(4)　【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)　株式
該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	508,972,778	1,552,468,767	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	1,279,480,111	1,559,814,203	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	459,562,052	1,563,292,232	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	436,012,950	1,549,982,435	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	272,054,012	1,199,350,111	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	134,800,822	307,453,714	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19,730,643	58,317,861	

	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	457,604,313	1,526,476,467	
親投資信託受益証券　合計			9,317,155,790	
合計			9,317,155,790	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）
当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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。
なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2022年1月12日から2023年1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3月3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ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2022年1月12日から2023年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2023年1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計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、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】

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1)　【貸借対照表】

	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1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	165,287,633	187,220,313
親投資信託受益証券	10,450,112,147	11,933,829,476
未収入金	12,688,000	11,081,000
流動資産合計	10,628,087,780	12,132,130,789
資産合計	10,628,087,780	12,132,130,789
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,385,252	13,837,692
未払受託者報酬	2,729,359	3,322,675
未払委託者報酬	62,776,129	76,422,365
その他未払費用	409,320	498,329
流動負債合計	83,300,060	94,081,061
負債合計	83,300,060	94,081,061
純資産の部		
元本等		
元本　※1	4,264,260,205	5,076,067,557
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,280,527,515	6,961,982,171
（分配準備積立金）	2,702,131,901	2,454,582,841
元本等合計	10,544,787,720	12,038,049,728
純資産合計	10,544,787,720	12,038,049,728
負債純資産合計	10,628,087,780	12,132,130,789

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第16期 自 2021年1月13日 至 2022年1月11日	第17期 自 2022年1月12日 至 2023年1月10日
	金　額（円）	金　額（円）
営業収益		
受取利息	27	17
有価証券売買等損益	1,839,070,441	△343,601,671
営業収益合計	1,839,070,468	△343,601,654
営業費用		
支払利息	29,312	47,263
受託者報酬	4,980,252	6,273,233
委託者報酬 ※1	114,547,848	144,286,151
その他費用	746,925	940,830
営業費用合計	120,304,337	151,547,477
営業利益又は営業損失（△）	1,718,766,131	△495,149,131
経常利益又は経常損失（△）	1,718,766,131	△495,149,131
当期純利益又は当期純損失（△）	1,718,766,131	△495,149,131
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	103,914,899	△16,354,644
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,657,471,538	6,280,527,515
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,441,476,246	1,812,452,390
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,441,476,246	1,812,452,390
剰余金減少額又は欠損金増加額	433,271,501	652,203,247
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	433,271,501	652,203,247
分配金 ※2	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,280,527,515	6,961,982,171

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2022年1月10日が休日のため、前計算期間末日を2022年1月11日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1.　※1　期首元本額	3,580,161,955円	4,264,260,205円
期中追加設定元本額	1,096,214,144円	1,255,999,989円
期中一部解約元本額	412,115,894円	444,192,637円
2.　計算期間末日における受益権の総数	4,264,260,205口	5,076,067,557口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第16期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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	19,884,417円	24,880,913円
2.　※2　分配金の計算過程	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（0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（1,614,854,868円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,104,543,539円）及び	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（0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（5,647,906,216円）及び分配準備積立金

	分配準備積立金 （1,087,277,033 円）より分配可能額は 6,806,675,440 円（1 万口当たり 15,962.15 円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。	（2,454,582,841 円）より分配可能額は 8,102,489,057 円（1 万口当たり 15,962.14 円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。

（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	第 17 期 自　2022 年 1 月 12 日 至　2023 年 1 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
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	第 17 期 2023 年 1 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	第16期 2022年1月11日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第17期 2023年1月10日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,794,888,396	△345,163,977
合計	1,794,888,396	△345,163,977

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第17期 自　2022年1月12日 至　2023年1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）

	第16期 2022年1月11日現在	第17期 2023年1月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4728円 (24,728円)	2.3715円 (23,715円)

(4)　【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)　株式
該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	195,815,995	597,277,947	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	490,703,172	598,216,236	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	708,970,209	2,411,703,959	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	835,574,751	2,970,384,682	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	523,508,691	2,307,888,064	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	259,462,979	591,783,162	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	37,914,155	112,062,867	

	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	702,833,671	2,344,512,559	
親投資信託受益証券　合計			11,933,829,476	
合計			11,933,829,476	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）
当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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。
なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
　なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年1月11日から2023年7月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023 年 8 月 25 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	竹内　知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2023年1月11日から2023年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月11日から2023年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1)【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		125,579,506
親投資信託受益証券		8,958,904,364
未収入金		7,503,000
流動資産合計		9,091,986,870
資産合計		9,091,986,870
負債の部		
流動負債		
未払解約金		9,175,354
未払受託者報酬		2,318,951
未払委託者報酬		39,422,961
その他未払費用		347,754
流動負債合計		51,265,020
負債合計		51,265,020
純資産の部		
元本等		
元本	※1	4,427,735,962
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）		4,612,985,888
（分配準備積立金）		1,248,734,620
元本等合計		9,040,721,850
純資産合計		9,040,721,850
負債純資産合計		9,091,986,870

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日 金　額（円）
営業収益	
受取利息	33
有価証券売買等損益	631,836,596
その他収益	248
営業収益合計	631,836,877
営業費用	
支払利息	17,823
受託者報酬	2,318,951
委託者報酬　※1	39,422,961
その他費用	347,754
営業費用合計	42,107,489
営業利益又は営業損失（△）	589,729,388
経常利益又は経常損失（△）	589,729,388
中間純利益又は中間純損失（△）	589,729,388
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	16,484,517
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,791,839,420
剰余金増加額又は欠損金減少額	428,850,008
中間追加信託に伴う剰余金増加額 　又は欠損金減少額	428,850,008
剰余金減少額又は欠損金増加額	180,948,411
中間一部解約に伴う剰余金減少額 　又は欠損金増加額	180,948,411
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,612,985,888

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	4,186,631,287 円
期中追加設定元本額	440,309,926 円
期中一部解約元本額	199,205,251 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,427,735,962 口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
※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	5,201,303 円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	2.0418 円 （20,418 円）

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,259,098,528
コール・ローン	1,548,974,010
国債証券	255,599,544,647
未収入金	7,344
未収利息	1,802,843,541
前払費用	89,905,752
流動資産合計	261,300,373,822
資産合計	261,300,373,822
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,600,018
未払金	89,104
未払解約金	292,292,110
その他未払費用	5,940
流動負債合計	301,987,172
負債合計	301,987,172
純資産の部	
元本等	
元本　※1	79,754,303,884
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	181,244,082,766
元本等合計	260,998,386,650
純資産合計	260,998,386,650
負債純資産合計	261,300,373,822

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
1.　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）、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	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	76,916,702,172 円
期中追加設定元本額	5,757,219,111 円
期中一部解約元本額	2,919,617,399 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	414,086,454 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	7,816,697 円

区分	2023年7月10日現在
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	44,476,595円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	16,787,939円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	220,964,168円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	477,773,362円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	763,847,681円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	3,188,153,384円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	844,539,247円
Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックス	1,705,806円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,937,198円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,181,266,806円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,140,646,854円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	428,001,355円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	15,487円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,751,573,290円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,136,331,240円
ダイワ・ライフ・バランス５０	754,978,503円
ダイワ・ライフ・バランス７０	552,956,404円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	680,876,830円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	532,982,198円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	209,381,878円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	34,901,645円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	17,137,651円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,676,480,098円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,477,147円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,656,130円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	2,915,072円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	597,259,900円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	108,528,438円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	28,955,111円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,060,003,814円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	196,446,971円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	157,363,230円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	60,686,337円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,601,517,331円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,733,278,022円
ダイワライフスタイル２５	27,751,329円

区分	2023年7月10日現在
ダイワライフスタイル５０	61,217,769円
ダイワライフスタイル７５	16,628,513円
計	79,754,303,884円
2. 期末日における受益権の総数	79,754,303,884口

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,308,921,235	－	1,299,321,217	△9,600,018
アメリカ・ドル	223,174,732	－	221,222,912	△1,951,820
イギリス・ポンド	24,648,336	－	24,589,250	△59,086
オフショア・人民元	823,290,865	－	817,076,032	△6,214,833
カナダ・ドル	11,014,366	－	11,013,687	△679
シンガポール・ドル	37,355,034	－	37,029,587	△325,447
ポーランド・ズロチ	32,773,065	－	32,345,162	△427,903
ユーロ	156,664,837	－	156,044,587	△620,250

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
合計	1,308,921,235	－	1,299,321,217	△9,600,018

（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）

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2725円 （32,725円）

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	339,983,123
国債証券	40,873,398,060
地方債証券	2,887,737,959
特殊債券	1,128,011,400
社債券	3,148,664,200
未収入金	146,052,400
未収利息	57,883,128
前払費用	3,957,955
流動資産合計	48,585,688,225
資産合計	48,585,688,225
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	217,637
流動負債合計	300,217,637
負債合計	300,217,637
純資産の部	
元本等	
元本　※1	38,746,478,209
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,538,992,379
元本等合計	48,285,470,588
純資産合計	48,285,470,588
負債純資産合計	48,585,688,225

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 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	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	34,357,539,560 円
期中追加設定元本額	4,745,335,418 円
期中一部解約元本額	356,396,769 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	2,180,615,887 円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	3,524,372,686 円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,572,824,913 円
ダイワ・ライフ・バランス３０	10,866,765,472 円
ダイワ・ライフ・バランス５０	7,917,071,913 円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,932,683,280 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,783,469,774 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,385,993,177 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	545,968,712 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,706,370,278 円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	43,708,483 円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	17,502,075 円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	15,563,651 円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	207,144,805 円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	46,423,103 円
計	38,746,478,209 円
2.　期末日における受益権の総数	38,746,478,209 口

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2462円 （12,462円）

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,447,319,902
コール・ローン	281,024,938
投資証券	88,255,806,811
派生商品評価勘定	44,885
未収入金	289,733,336
未収配当金	452,308,413
流動資産合計	90,726,238,285
資産合計	90,726,238,285
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,793
未払金	522,926,650
未払解約金	92,955,000
その他未払費用	5,940
流動負債合計	615,889,383
負債合計	615,889,383
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	24,640,923,468
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	65,469,425,434
元本等合計	90,110,348,902
純資産合計	90,110,348,902
負債純資産合計	90,726,238,285

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	26,103,872,416 円
期中追加設定元本額	372,385,187 円

区分	2023年7月10日現在
期中一部解約元本額	1,835,334,135円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
グローバルＲＥＩＴ・オープン（適格機関投資家専用）	822,979円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（毎月分配型）	19,361,462,380円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	21,756,529円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,473,025円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,382,207円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	40,533,096円
６資産バランスファンド（分配型）	72,431,226円
６資産バランスファンド（成長型）	207,775,751円
りそな ワールド・リート・ファンド	917,696,071円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	19,701,952円
常陽３分法ファンド	92,551,096円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	23,523,486円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／毎月分配型）	41,615,551円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジなし／資産成長型）	552,523,121円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（為替ヘッジあり／資産成長型）	568,302,114円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	370,506,406円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	485,388,075円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	764,951,709円
グローバルＲＥＩＴファンド2021-07（適格機関投資家専用）	825,267,450円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	211,099,640円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）	18,554,587円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	25,605,017円
計	24,640,923,468円
2. 期末日における受益権の総数	24,640,923,468口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7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。

区分	2023年7月10日現在
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	81,410,757	－	81,399,416	11,341
アメリカ・ドル	16,695,437	－	16,692,872	2,565
イギリス・ポンド	45,596,234	－	45,589,476	6,758
ユーロ	19,119,086	－	19,117,068	2,018
買建	81,410,757	－	81,442,508	31,751
アメリカ・ドル	64,715,320	－	64,738,962	23,642
オーストラリア・ドル	16,695,437	－	16,703,546	8,109
合計	162,821,514	－	162,841,924	43,092

（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)

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6569円 (36,569円)

「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

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,749,156,810
株式	22,825,015,080
未収入金	564,679,078
未収配当金	30,557,300
前払金	7,475,000
差入委託証拠金	18,000,000
流動資産合計	25,194,883,268
資産合計	25,194,883,268
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,586,000
未払金	428,415,490
未払解約金	4,440,000
流動負債合計	443,441,490
負債合計	443,441,490
純資産の部	
元本等	
元本　※1	5,713,900,546
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	19,037,541,232
元本等合計	24,751,441,778
純資産合計	24,751,441,778
負債純資産合計	25,194,883,268

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	4,640,307,388 円
期中追加設定元本額	1,340,627,018 円
期中一部解約元本額	267,033,860 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）	3,926,764,891 円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	19,859,514 円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,732,367 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,181,105 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	239,750,180 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	33,067,929 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	40,093,377 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	208,460,126 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	411,307,170 円

区分	2023年7月10日現在
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	802,683,887円
計	5,713,900,546円
2. 期末日における受益権の総数	5,713,900,546口

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	458,275,000	－	447,700,000	△10,575,000
合計	458,275,000	－	447,700,000	△10,575,000

（注）
1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1 口当たり情報）

	2023 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	4.3318 円 （43,318 円）

「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

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	321,143,110
コール・ローン	31,127,944
株式	3,943,425,999
優先出資証券	929,349,075
投資証券	61,025,640
未収配当金	3,618,824
未収利息	2,412,738
流動資産合計	5,292,103,330
資産合計	5,292,103,330
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,498,000
その他未払費用	5,940
流動負債合計	4,503,940
負債合計	4,503,940
純資産の部	
元本等	
元本　※1	1,026,474,186
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,261,125,204
元本等合計	5,287,599,390
純資産合計	5,287,599,390
負債純資産合計	5,292,103,330

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)優先出資証券 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、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
	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、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 優先出資証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	1,041,508,142 円
期中追加設定元本額	33,790,301 円
期中一部解約元本額	48,824,257 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,941,381 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	3,915,157 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	67,018,198 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	9,018,311 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	11,020,720 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	136,072,915 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	269,607,759 円

区分	2023年7月10日現在
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	524,879,745円
計	1,026,474,186円
2. 期末日における受益権の総数	1,026,474,186口

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2023年7月10日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.1512円 （51,512円）

「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

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	71,852,058
コール・ローン	25,718,346
株式	1,578,136,089
未収配当金	2,416,056
流動資産合計	1,678,122,549
資産合計	1,678,122,549
負債の部	
流動負債	
未払解約金	960,000
その他未払費用	5,940
流動負債合計	965,940
負債合計	965,940
純資産の部	
元本等	
元本　※1	652,329,994
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,024,826,615
元本等合計	1,677,156,609
純資産合計	1,677,156,609
負債純資産合計	1,678,122,549

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	683,447,022 円
期中追加設定元本額	34,175,588 円
期中一部解約元本額	65,292,616 円

区分	2023年7月10日現在
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,400,890円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,775,249円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	132,390,121円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	18,083,489円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	21,941,919円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	67,522,957円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	134,145,667円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	261,069,702円
計	652,329,994円
2. 期末日における受益権の総数	652,329,994口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年7月10日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5710円 (25,710円)

「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

	2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,768,332
コール・ローン	1,545,084
株式	677,610,345
未収入金	254,845
未収配当金	4,517,453
流動資産合計	693,696,059
資産合計	693,696,059
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,262
未払解約金	748,000
その他未払費用	5,940
流動負債合計	755,202
負債合計	755,202
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	218,097,136
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	474,843,721
元本等合計	692,940,857
純資産合計	692,940,857
負債純資産合計	693,696,059

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	236,240,519 円
期中追加設定元本額	9,410,373 円
期中一部解約元本額	27,553,756 円

区分	2023年7月10日現在
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）	7,625,750円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,147,132円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	106,592,074円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	14,643,498円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	17,679,110円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	9,572,134円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	19,058,265円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	36,779,173円
計	218,097,136円
2. 期末日における受益権の総数	218,097,136口

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
売建	1,903,712	－	1,904,974	△1,262
オーストラリア・ドル	1,903,712	－	1,904,974	△1,262
合計	1,903,712	－	1,904,974	△1,262

(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)

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1772円 (31,772円)

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,773,366,313
投資証券	※2	147,584,941,200
派生商品評価勘定		157,800
未収入金		266,382,146
未収配当金		1,132,391,403
前払金		16,510,000
流動資産合計		152,773,748,862
資産合計		152,773,748,862
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		14,703,000
未払金		2,325,478,188
未払解約金		1,070,000
流動負債合計		2,341,251,188
負債合計		2,341,251,188
純資産の部		
元本等		
元本	※1	43,642,322,904
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		106,790,174,770
元本等合計		150,432,497,674
純資産合計		150,432,497,674
負債純資産合計		152,773,748,862

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	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、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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023 年 7 月 10 日現在
1.　※1 期首	2023 年 1 月 11 日
期首元本額	42,460,993,574 円
期中追加設定元本額	3,369,731,361 円
期中一部解約元本額	2,188,402,031 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ・J-REIT ファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	40,522,092,708 円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,179,233 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,922,671 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	43,762,365 円
６資産バランスファンド（分配型）	75,286,260 円
６資産バランスファンド（成長型）	218,048,682 円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	20,845,419 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	25,083,701 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	390,295,498 円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	506,915,031 円

区分	2023年7月10日現在
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	799,426,878円
ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	241,157,362円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	55,642,379円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	18,321,188円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	90,988,033円
ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年4回決算型）	614,355,496円
計	43,642,322,904円
2. 期末日における受益権の総数	43,642,322,904口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　964,200,000円

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
不動産投信				
指数先物取引				

種類	2023年7月10日現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
買建	2,436,600,000	－	2,422,200,000	△14,400,000
合計	2,436,600,000	－	2,422,200,000	△14,400,000

（注）　1.　時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2.　不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3.　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年7月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4469円 （34,469円）

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
　なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年1月11日から2023年7月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023 年 8 月 25 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	竹内　知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）の2023年1月11日から2023年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）の2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月11日から2023年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）

(1)【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		160,056,873
親投資信託受益証券		10,569,654,325
未収入金		69,000
流動資産合計		10,729,780,198
資産合計		10,729,780,198
負債の部		
流動負債		
未払解約金		6,314,874
未払受託者報酬		2,726,961
未払委託者報酬		54,540,156
その他未払費用		408,962
流動負債合計		63,990,953
負債合計		63,990,953
純資産の部		
元本等		
元本	※1	4,664,257,152
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）		6,001,532,093
（分配準備積立金）		1,639,989,233
元本等合計		10,665,789,245
純資産合計		10,665,789,245
負債純資産合計		10,729,780,198

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日 金　額（円）
営業収益	
受取利息	40
有価証券売買等損益	914,651,535
その他収益	431
営業収益合計	914,652,006
営業費用	
支払利息	21,780
受託者報酬	2,726,961
委託者報酬　※1	54,540,156
その他費用	408,962
営業費用合計	57,697,859
営業利益又は営業損失（△）	856,954,147
経常利益又は経常損失（△）	856,954,147
中間純利益又は中間純損失（△）	856,954,147
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	24,009,594
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,923,062,448
剰余金増加額又は欠損金減少額	518,129,011
中間追加信託に伴う剰余金増加額 　又は欠損金減少額	518,129,011
剰余金減少額又は欠損金増加額	272,603,919
中間一部解約に伴う剰余金減少額 　又は欠損金増加額	272,603,919
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,001,532,093

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	4,475,748,849 円
期中追加設定元本額	435,742,296 円
期中一部解約元本額	247,233,993 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	4,664,257,152 口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
※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	8,089,621 円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	2.2867 円 （22,867 円）

（参考）
当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。
なお、当ファンドの中間計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況
前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

【ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
　なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年1月11日から2023年7月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023 年 8 月 25 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	竹内　知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2023年1月11日から2023年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月11日から2023年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1)【中間貸借対照表】

	当中間計算期間末 2023年7月10日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	222,732,044
親投資信託受益証券	13,887,376,406
未収入金	2,165,000
流動資産合計	14,112,273,450
資産合計	14,112,273,450
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,116,752
未払受託者報酬	3,524,948
未払委託者報酬	81,074,796
その他未払費用	528,664
流動負債合計	98,245,160
負債合計	98,245,160
純資産の部	
元本等	
元本　※1	5,317,811,133
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,696,217,157
（分配準備積立金）	2,321,018,359
元本等合計	14,014,028,290
純資産合計	14,014,028,290
負債純資産合計	14,112,273,450

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日 金　額（円）
営業収益	
受取利息	56
有価証券売買等損益	1,460,717,930
その他収益	8,612
営業収益合計	1,460,726,598
営業費用	
支払利息	29,393
受託者報酬	3,524,948
委託者報酬　※1	81,074,796
その他費用	528,664
営業費用合計	85,157,801
営業利益又は営業損失（△）	1,375,568,797
経常利益又は経常損失（△）	1,375,568,797
中間純利益又は中間純損失（△）	1,375,568,797
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	40,250,549
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,961,982,171
剰余金増加額又は欠損金減少額	799,989,546
中間追加信託に伴う剰余金増加額 　又は欠損金減少額	799,989,546
剰余金減少額又は欠損金増加額	401,072,808
中間一部解約に伴う剰余金減少額 　又は欠損金増加額	401,072,808
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,696,217,157

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. ※1 期首元本額	5,076,067,557 円
期中追加設定元本額	533,239,485 円
期中一部解約元本額	291,495,909 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,317,811,133 口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	当中間計算期間 自 2023 年 1 月 11 日 至 2023 年 7 月 10 日
※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	14,062,308 円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	当中間計算期間末 2023 年 7 月 10 日現在
1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	2.6353 円 （26,353 円）

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」に記載のとおりであります。

２【ファンドの現況】

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

【純資産額計算書】

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	9,185,799,161 円
Ⅱ	負債総額	8,823,828 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,176,975,333 円
Ⅳ	発行済数量	4,451,417,770 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0616 円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	264,004,812,825 円
Ⅱ	負債総額	32,839,387 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	263,971,973,438 円
Ⅳ	発行済数量	80,508,567,312 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2788 円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	48,685,330,833 円
Ⅱ	負債総額	8,943,412 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,676,387,421 円
Ⅳ	発行済数量	39,430,349,957 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2345 円

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

純資産額計算書

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	92,384,630,500 円
Ⅱ	負債総額	13,865,000 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	92,370,765,500 円
Ⅳ	発行済数量	24,625,529,684 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7510 円

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	163,029,302,158 円
Ⅱ	負債総額	1,450,112,547 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	161,579,189,611 円
Ⅳ	発行済数量	46,223,615,494 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4956 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

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	5,368,289,916 円
Ⅱ	負債総額	1,427,000 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,366,862,916 円
Ⅳ	発行済数量	1,019,065,225 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.2665 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

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	1,700,494,523 円
Ⅱ	負債総額	1,243,000 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,699,251,523 円
Ⅳ	発行済数量	633,866,513 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6808 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

2023年7月31日

Ⅰ	資産総額	692,446,852円
Ⅱ	負債総額	1,137,114円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	691,309,738円
Ⅳ	発行済数量	205,997,495口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3559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

2023年7月31日

Ⅰ	資産総額	27,136,024,245円
Ⅱ	負債総額	1,082,037,074円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,053,987,171円
Ⅳ	発行済数量	5,815,848,002口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.4798円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）

純資産額計算書

2023年7月31日

Ⅰ	資産総額	10,901,237,563円
Ⅱ	負債総額	15,561,361円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,885,676,202円
Ⅳ	発行済数量	4,690,224,061口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3209円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

純資産額計算書

2023 年 7 月 31 日

Ⅰ	資産総額	14,414,552,717 円
Ⅱ	負債総額	16,781,444 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,397,771,273 円
Ⅳ	発行済数量	5,345,494,578 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6934 円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

(5) 受益権の譲渡
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け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【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
2023年7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。

2023 年 7 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	93	318,818
追加型株式投資信託	778	24,050,263
株式投資信託　　合計	871	24,369,081
単位型公社債投資信託	104	179,654
追加型公社債投資信託	14	1,554,962
公社債投資信託　合計	118	1,734,616
総合計	989	26,103,697

３【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2022年４月１日から2023年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

独立監査人の監査報告書

2023 年５月 26 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注) 1.　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2.　XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,168		1,982
有価証券		486		346
前払費用		332		393
未収委託者報酬		13,811		12,525
未収収益		52		47
関係会社短期貸付金		24,900		22,100
その他		45		59
流動資産計		42,799		37,455
固定資産				
有形固定資産	※1	203	※1	196
建物		4		3
器具備品		198		193
無形固定資産		1,770		1,482
ソフトウェア		1,738		1,351
ソフトウェア仮勘定		31		131
投資その他の資産		16,617		13,824
投資有価証券		10,755		8,260
関係会社株式		3,705		3,475
出資金		177		177
長期差入保証金		1,067		1,066
繰延税金資産		885		824
その他		26		20
固定資産計		18,591		15,503
資産合計		61,390		52,959

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		65		101
未払金		9,856		5,874
未払収益分配金		26		38
未払償還金		12		12
未払手数料		4,917		4,525
その他未払金	※2	4,900	※2	1,297
未払費用		4,246		3,987
未払法人税等		980		560
未払消費税等		1,016		327
賞与引当金		866		692
その他		2		2
流動負債計		17,033		11,545
固定負債				
退職給付引当金		2,399		2,276
役員退職慰労引当金		13		51
その他		1		0
固定負債計		2,415		2,329
負債合計		19,449		13,874
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		13,925		11,505
利益剰余金合計		14,299		11,879
株主資本合計		40,969		38,549
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		971		534
評価・換算差額等合計		971		534
純資産合計		41,941		39,084
負債・純資産合計		61,390		52,959

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692
福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	327	286
有価証券償還益	40	150
その他	264	171
営業外収益計	631	608
営業外費用		
投資有価証券売却損	59	244
有価証券償還損	0	2
その他	34	31
営業外費用計	93	277
経常利益	19,089	15,642
特別損失		
関係会社整理損失	－	229
投資有価証券評価損	331	257
特別損失計	331	486
税引前当期純利益	18,757	15,155
法人税、住民税及び事業税	5,950	4,589
法人税等調整額	69	248
法人税等合計	6,019	4,838
当期純利益	12,738	10,317

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）

（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

当事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	15～18 年
器具備品	４～20 年

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

３．引当金の計上基準
（１）賞与引当金
役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。
（２）退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員･参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。
（３）役員退職慰労引当金
役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．収益及び費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

（重要な会計上の見積り）
　該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）
（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）
　「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。
　なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-３項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

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

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
未払金	4,694百万円	1,178百万円

３　保証債務

前事業年度（2022年３月31日）
　子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2023年３月31日）
　子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,112百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

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

③１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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

①剰余金の配当の総額　10,316百万円

②配当の原資　利益剰余金

③１株当たり配当額　3,955円

④基準日　2023年３月31日

⑤効力発生日　2023年６月27日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係す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。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

前事業年度（2022 年３月 31 日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

当事業年度（2023 年３月 31 日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2022年３月31日）

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2022年３月31日）

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

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

４．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

（１）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	△ 303	△ 322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

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

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,399 百万円	2,276 百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,399	2,276

（３）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
勤務費用	152 百万円	150 百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	－	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	△ 356	△ 459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 562	△ 356
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 722	△ 515
繰延税金資産の純額	885	824

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2022年３月31日）

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021年８月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

（１）　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 69,845 百万円、その他 559 百万円であります。

（２）　収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３）　顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

１．サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90％を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90％を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90％を超えるため、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10％以上を占める相手先がないため、記載はありません。

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］
該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］
該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引
（ア）財務諸表提出会社の親会社
前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 0

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社
前事業年度（自　2021 年４月１日　至　2022 年３月 31 日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注） シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履

行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	2,112	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱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。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	13,072 1,062	未払手数料 長期差入保証金	2,663 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

（注4）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）		当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	
１株当たり純資産額	16,078.50円	１株当たり純資産額	14,983.42円
１株当たり当期純利益	4,883.43円	１株当たり当期純利益	3,955.35円

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

（注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	当事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
当期純利益（百万円）	12,738	10,317
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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

提出日前１年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース））

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第19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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

2．運用方法

(1) 投資対象

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

1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の25％
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
……信託財産の純資産総額の25％
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の15％
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の15％
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券……（Ａ）※
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券……（Ｂ）※
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……（Ｃ）※
…（Ａ）（Ｂ）（Ｃ）の合計で、信託財産の純資産総額の10％
（※上記3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。）
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の10％

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 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。

(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 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等とします。

② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。

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。

追加型証券投資信託
（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース））
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100万円を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、1,000億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41条第1項、第42条第1項、第43条第1項および第45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100万口に、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21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　この信託の受益権は、2007年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第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。）に当該申請の手続を委任することができます。

（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口単位として委託者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。

②　指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、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。

③　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。

④　第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または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、委託者または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31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12条の2　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12条の3　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13条　（削　　除）

第14条　（削　　除）

第15条　（削　　除）

（投資の対象とする資産の種類）

第16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17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8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、ならびに次の第9号から第12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. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
10. 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
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 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18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22条において同じ。）、第22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16条および第17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21条、第26条から第28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19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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第20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21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21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22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係る実績等に照らし、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23条　（削　　除）

（混蔵寄託）

第24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25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26条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド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27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28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29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30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31条　この信託の計算期間は、毎年1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1月12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32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33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34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31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90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、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および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・グローバルＲＥＩＴ・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57以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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。

⑥　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35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。

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。

（収益分配金の再投資）

第36条　収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、指定販売会社に支払われます。

②　指定販売会社は、積立投資契約に基づき、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　委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④　収益分配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。

（償還金および一部解約金の支払い）

第37条　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ます。）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。

② 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、5営業日目から受益者に支払います。

③ 前2項に規定する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。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④ 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38条 受託者は、収益分配金については第36条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1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2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。

（償還金の時効）

第39条 受益者が、信託終了による償還金について第37条第1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40条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に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。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、委託者また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40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41条 委託者は、信託期間中において、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42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46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43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46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44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45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46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46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、公告を行ないません。

（反対者の買取請求権）

第47条　第41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41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47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48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49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36条第4項および第37条第4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（受益証券の再交付）から第15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 1月12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

追加型証券投資信託

（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース））

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

運 用 の 基 本 方 針

約款第19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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

２．運用方法

(1) 投資対象

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

1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の16.7%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
……信託財産の純資産総額の16.7%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の16.7%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の16.7%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券……（Ａ）※
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券……（Ｂ）※
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……（Ｃ）※
……（Ａ）（Ｂ）（Ｃ）の合計で、信託財産の純資産総額の16.7%
（※ 上記3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。）
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16.7%

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 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。

(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 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等とします。

② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。

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。

追加型証券投資信託
（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース））
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100万円を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、1,000億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41条第1項、第42条第1項、第43条第1項および第45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100万口に、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21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　この信託の受益権は、2007年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第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。）に当該申請の手続を委任することができます。

（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口単位として委託者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。

②　指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、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。

③　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。

④　第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または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、委託者または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31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12条の2　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12条の3　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13条　（削　　除）

第14条　（削　　除）

第15条　（削　　除）

（投資の対象とする資産の種類）

第16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17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8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、ならびに次の第9号から第12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. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
10. 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
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 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18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22条において同じ。）、第22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16条および第17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21条、第26条から第28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19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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第20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21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21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22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係る実績等に照らし、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23条　（削　　除）

（混蔵寄託）

第24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25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26条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド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27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28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29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30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31条　この信託の計算期間は、毎年1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1月12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32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33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34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31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105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、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および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・グローバルＲＥＩＴ・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57以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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。

⑥　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35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。

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。

（収益分配金の再投資）

第36条　収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、指定販売会社に支払われます。

②　指定販売会社は、積立投資契約に基づき、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　委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④　収益分配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。

（償還金および一部解約金の支払い）

第37条　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ます。）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。

② 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、5営業日目から受益者に支払います。

③ 前2項に規定する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。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④ 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38条 受託者は、収益分配金については第36条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1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2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。

（償還金の時効）

第39条 受益者が、信託終了による償還金について第37条第1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40条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に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。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、委託者また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40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41条 委託者は、信託期間中において、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42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46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43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46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44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45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46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46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、公告を行ないません。

（反対者の買取請求権）

第47条　第41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41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47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48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49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36条第4項および第37条第4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（受益証券の再交付）から第15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 1月12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

追加型証券投資信託

（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース））

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

運 用 の 基 本 方 針

約款第19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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

２．運用方法

(1) 投資対象

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

1. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

② 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の 5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
……信託財産の純資産総額の 5%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の20%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の20%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券……（Ａ）※
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券……（Ｂ）※
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……（Ｃ）※
……（Ａ）（Ｂ）（Ｃ）の合計で、信託財産の純資産総額の25%
（※ 上記3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。）
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25%

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 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。

(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 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等とします。

② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。

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。

追加型証券投資信託
（ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース））
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100万円を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、1,000億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41条第1項、第42条第1項、第43条第1項および第45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100万口に、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21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　この信託の受益権は、2007年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第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。）に当該申請の手続を委任することができます。

（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口単位として委託者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。

②　指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、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。

③　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。

④　第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または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、委託者または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31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12条の2　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12条の3　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13条　（削　　除）

第14条　（削　　除）

第15条　（削　　除）

（投資の対象とする資産の種類）

第16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17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8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、ならびに次の第9号から第12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. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
10. 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
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 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18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22条において同じ。）、第22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16条および第17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21条、第26条から第28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19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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第20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21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21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22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係る実績等に照らし、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23条　（削　　除）

（混蔵寄託）

第24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25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26条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド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27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28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29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30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31条　この信託の計算期間は、毎年1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1月12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32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33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34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31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120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、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および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・グローバルＲＥＩＴ・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57以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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。

⑥　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35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。

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。

（収益分配金の再投資）

第36条　収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、指定販売会社に支払われます。

②　指定販売会社は、積立投資契約に基づき、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　委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④　収益分配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。

（償還金および一部解約金の支払い）

第37条　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ます。）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。

② 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、5営業日目から受益者に支払います。

③ 前2項に規定する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。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④ 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38条 受託者は、収益分配金については第36条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1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2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。

（償還金の時効）

第39条 受益者が、信託終了による償還金について第37条第1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40条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に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。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、委託者また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40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41条 委託者は、信託期間中において、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42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46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43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46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44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45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46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46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、公告を行ないません。

（反対者の買取請求権）

第47条　第41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41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47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48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49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36条第4項および第37条第4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（受益証券の再交付）から第15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 1月12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