

# 世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)

(愛称：ベストシックス)

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11月30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「世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)(愛称:ベストシックス)」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11月29日に関東財務局長に提出しており、2023年11月30日にその届出の効力が生じております。

発行者名	大和アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 小松 幹太
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）（愛称：ベストシックス）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.75%（税抜2.5%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

### (7)【申込期間】

2023年11月30日から2024年5月30日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

### (8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

**(9)【払込期日】**

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

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

**(10)【払込取扱場所】**

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

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

**(12)【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

##### (注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ

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

(注2) 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの

	格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合 資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	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

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

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

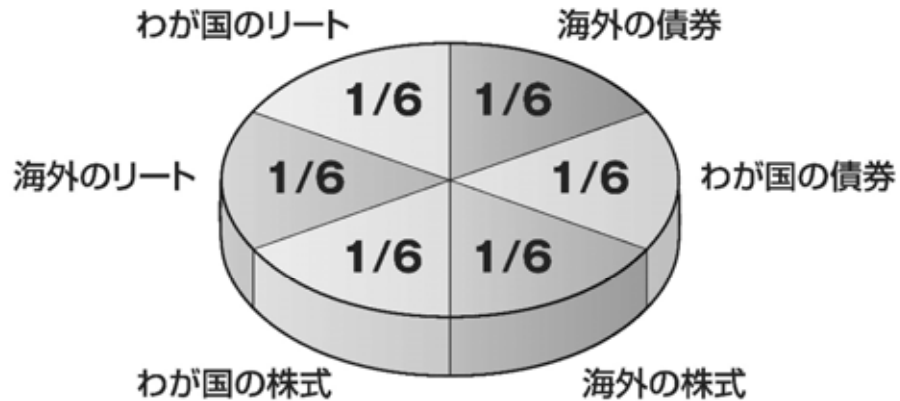
<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000 億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

# 1

内外の債券、株式およびリートに投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処とします。



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

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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





## 2 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

### ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上<sup>\*1</sup>、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上<sup>\*2</sup>とすることを基本とします。

### 債券の格付けについて

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

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

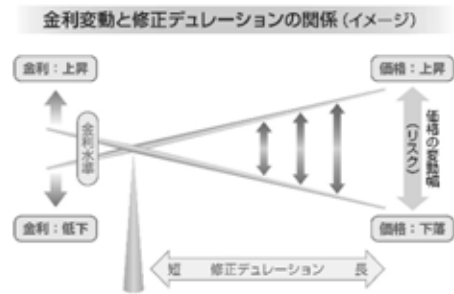
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

## 修正デュレーションについて

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



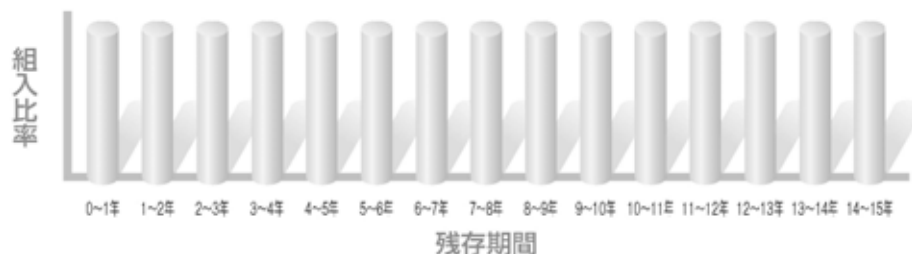
- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

## 3

わが国の債券への投資にあたっては、国債に投資します。

- 残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

### 残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

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

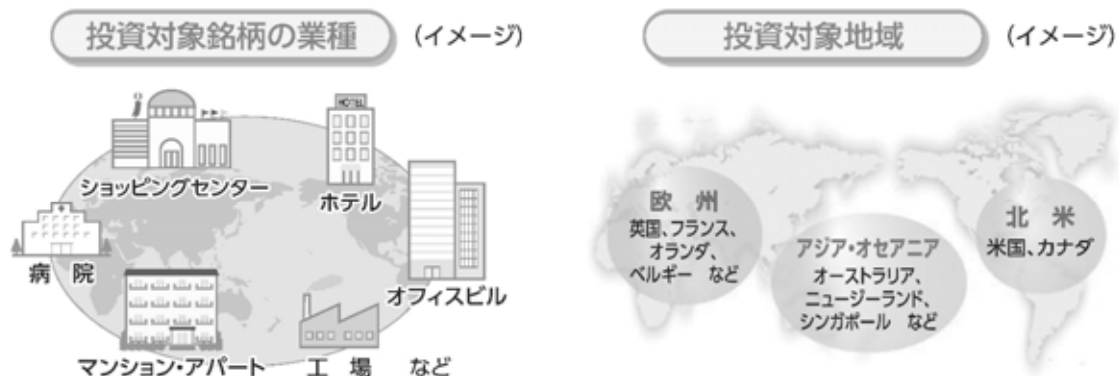
## 4 内外の株式への投資にあたっては、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資します。

- ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。
  - イ. 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。
  - ロ. 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

## 5 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・インクが行いません。

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。



※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。
- ・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。
- ・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。
- ・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。

• 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.~5.の運用が行なわれないことがあります。

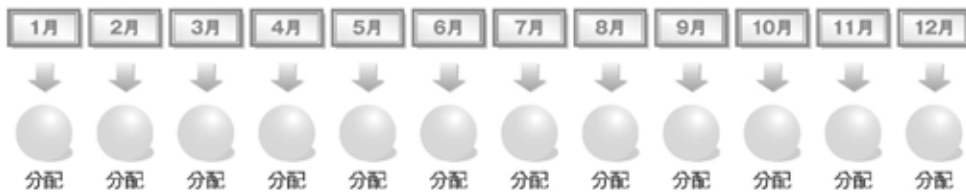
# 6

毎月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

## 収益分配のイメージ



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

## [収益分配金に関する留意事項]

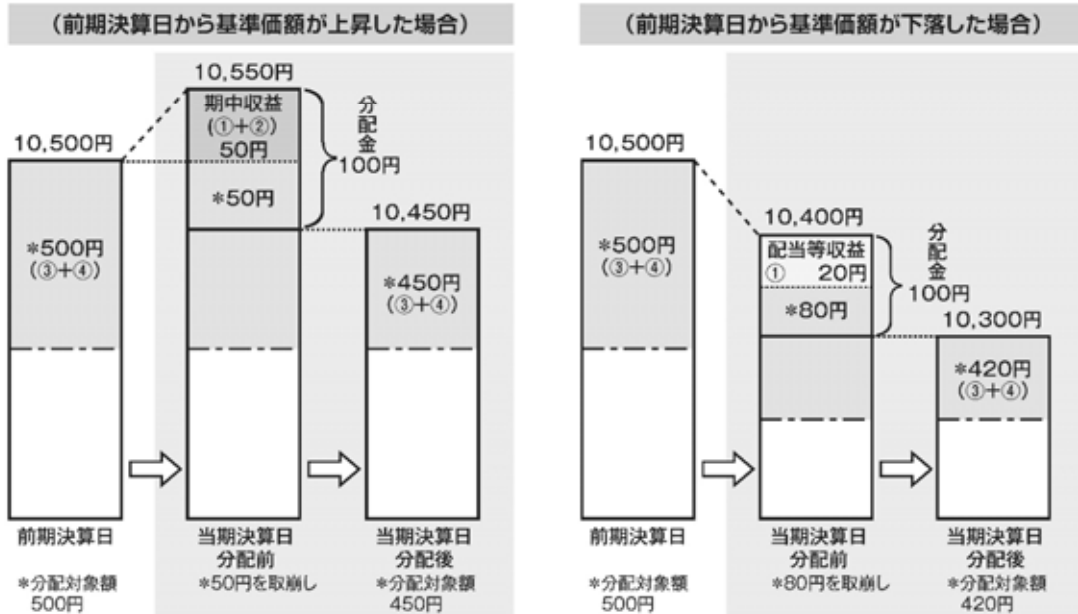
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)



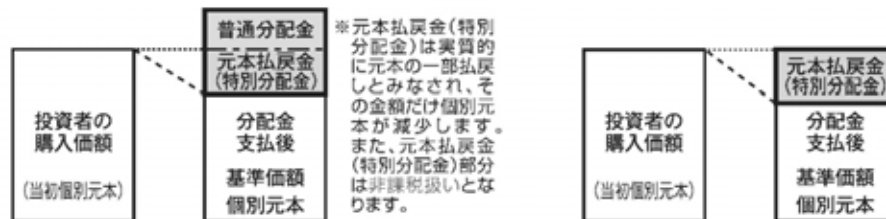
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)

(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006年6月28日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※5）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※5）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	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、「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、投資顧問会社（コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します。	

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（※3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、同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9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
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### ① 主要投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
6. ダイワJ-REITアクティブ・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、株式、および不動産投資信託証券に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

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



ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の 6 分の 1  
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の 6 分の 1  
ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の 6 分の 1  
ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の 6 分の 1  
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 6 分の 1  
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 6 分の 1

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

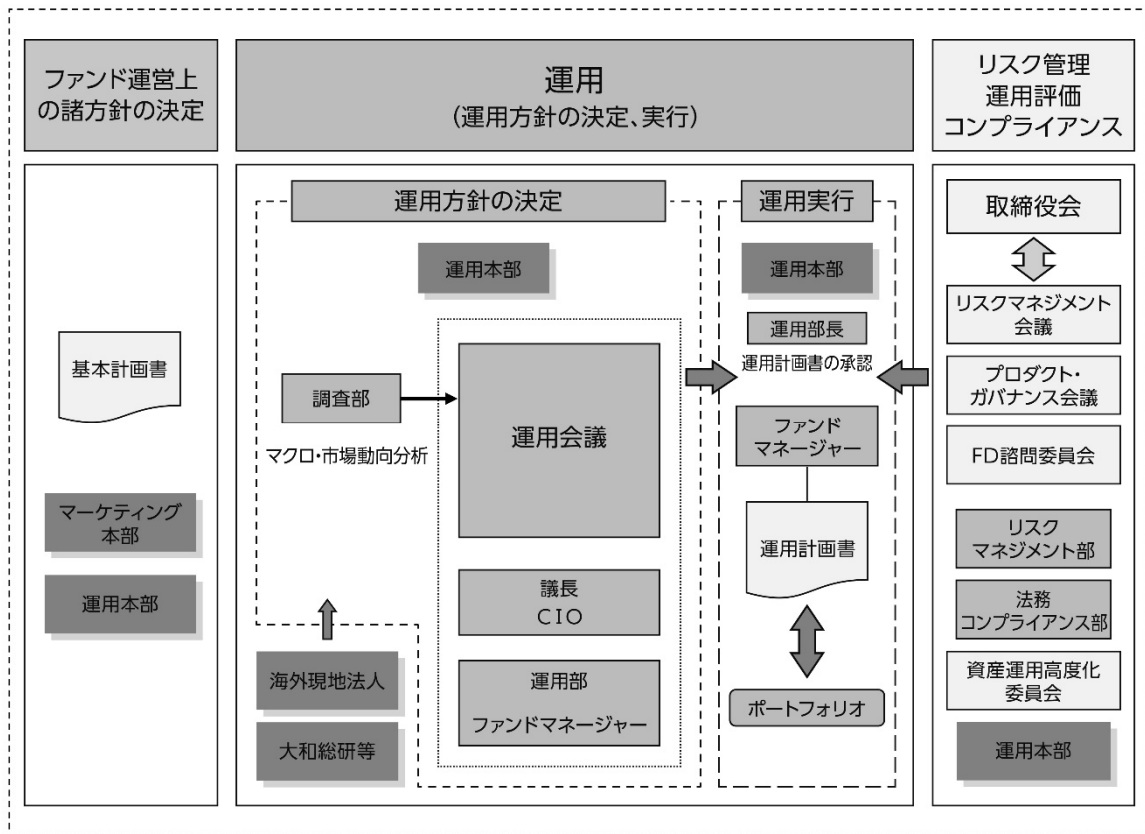
ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (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、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 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形

## (3) 【運用体制】

- 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。

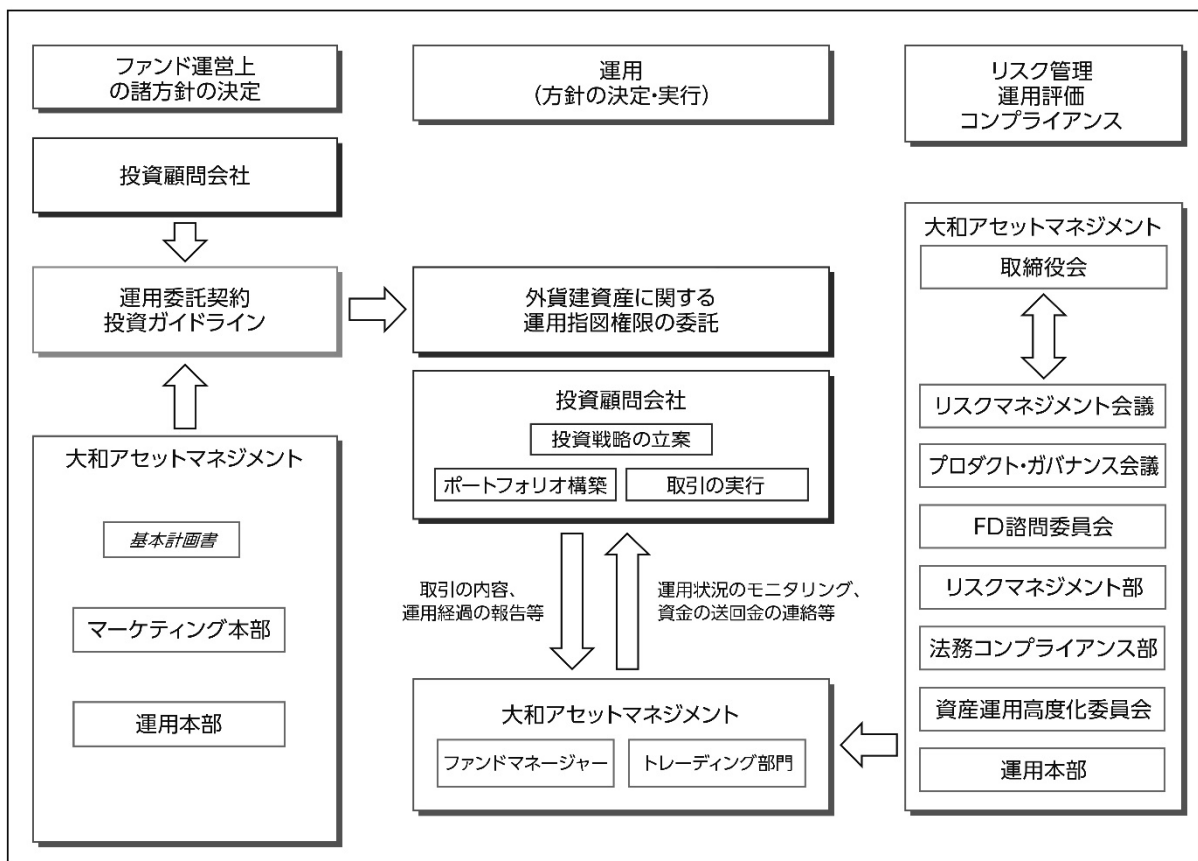
ニ. 資産運用高度化委員会

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が決裁により決定します。なお、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 9 月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に 6 月と 12 月の計算期末に分配する場合があります。

ます。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。なお、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

- ① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

- ② 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. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

- (1) 投資方針

- ① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

- ② 投資態度

- イ. 主として海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
- ロ. 海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
  - a. 米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2 通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の 50%程度ずつとすることを基本とします。  
 ※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ  
 ※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等
  - b. ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を 50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を 50%程度とすることを基本とします（ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。）。
  - c. 国債については、取得時において A 格相当以上（ムーディーズで A 3 以上または S & P で A- 以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時において AA 格相当以上（ムーディーズで A a 3 以上または S & P で AA- 以上）とすることを基本とします。
  - d. ポートフォリオの修正デュレーションは 5（年）程度から 10（年）程度の範囲を基本とします。
  - e. 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。
- ハ. 為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の 100%に近づけることを基本とします。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

- 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)④、⑤および⑥に定めるものに限りま。）
      - 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。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
  - 2. 国債証券

3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. コマーシャル・ペーパー
  8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
  9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  12. 預託証書（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、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
  - ② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
  - ④ 先物取引等
- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等

- 先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 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総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 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総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 2. ダイワ日本国債マザーファンド

### (1) 投資方針



- ① 主要投資対象  
わが国の公社債を主要投資対象とします。
- ② 投資態度
- イ. 主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- ロ. わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長 15 年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ. 国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ. 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
- (2) 投資対象
- 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. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
  2. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- 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. ～16. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- なお、前 1. の証券または証書、前 8. ならびに前 12. の証券または証書のうち前 1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前 2. から前 6. までの証券および前 8. ならびに前 12. の証券または証書のうち前 2. から前 6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前 9. の証券および前 10. の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- (3) 主な投資制限
- ① (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
  - ② (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
  - ③ 外貨建資産への投資は、行ないません。
  - ④ 先物取引等
- イ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- ロ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ. と同規定)
- 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. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- ハ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

- ホ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- 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、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)
- ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとし、
- ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとし、

### 3. ダイワ外国ハーモニースtock・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株式および店頭登録株式(上場予定および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. 主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。
- ロ. ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。
- (a) 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します(外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。)
- (b) 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。
- ハ. 株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。
- ニ. 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。
- 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、後掲(3)③、④および⑤に定めるものに限り、)
- 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 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 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)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. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)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. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

4. ダイワ日本ハーモニースtock・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の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ. （ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定）

ハ. 株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上と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、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. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 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. 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 （ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、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. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)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金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)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. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。

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

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 5. 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&ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ニ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
- ホ. 外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ヘ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

#### 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。

## 6. 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、通常の状態では信託財産の純資産総額の 80%程度以上に維持することを基本とします。
- 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、後掲(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. 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. 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 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 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

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

1. 先物取引の売建の指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)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【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、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、よろしくごお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### ① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### ② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### ③ 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、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーートの収益は、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ます。

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

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

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。

#### ④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

#### ⑤ その他

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

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

### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所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け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の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け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。

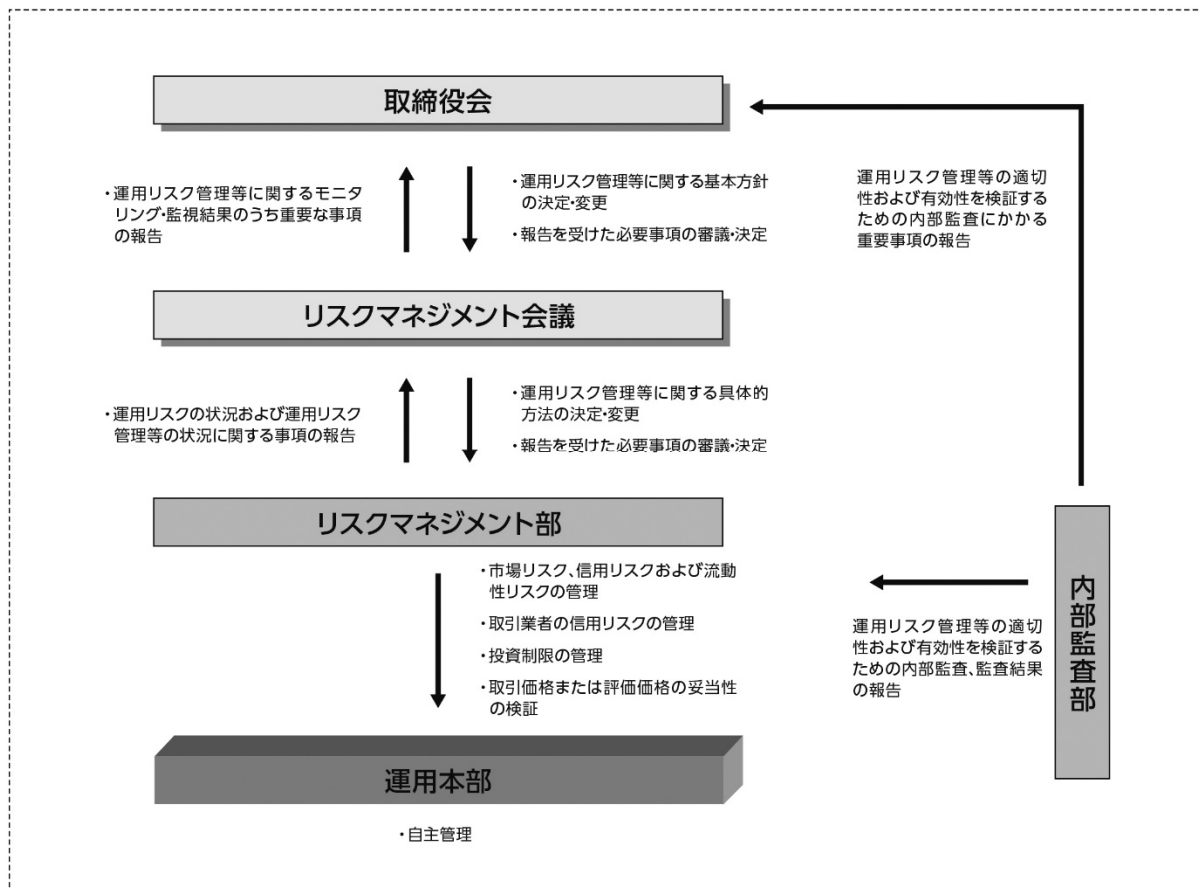
※ 流動性リスクに関する事項

- 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、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制(※)は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

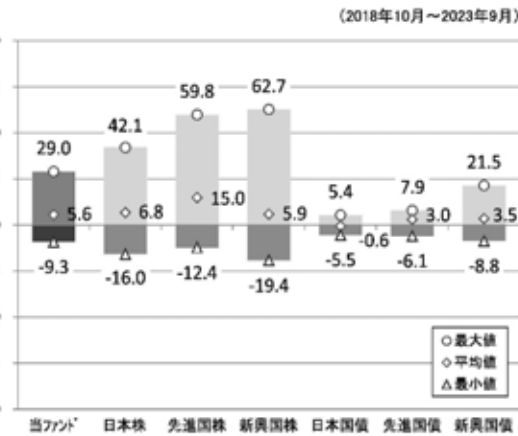
## 参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.75%（税抜2.5%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

### (2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料  
ありません。
- ② 信託財産留保額  
ありません。

### (3)【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 1.441%（税抜 1.31%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.63% (税抜)	年率 0.63% (税抜)	年率 0.05% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- ④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。
- ⑤ 委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・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。  
・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。

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、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。

### ① 個人の投資者に対する課税

#### イ. 収益分配金に対する課税

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

#### ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ. 損益通算について

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

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

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



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

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

## ② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

### <注1>個別元本について

- ① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。
- ④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

### <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9月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

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

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

## 5 【運用状況】

### (1) 【投資状況】 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	430,396,964	98.65
内 日本	430,396,964	98.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,873,119	1.35
純資産総額	436,270,083	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9月29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	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	39,229,908	1.9904 78,083,209	1.9168 75,195,887	17.24
2	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	16,328,798	4.6175 75,399,857	4.4564 72,767,655	16.68
3	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	37,544,149	1.9583 73,522,706	1.9247 72,261,223	16.56
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	20,560,705	3.5801 73,609,380	3.4892 71,740,411	16.44
5	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	19,430,802	3.7754 73,359,049	3.5870 69,698,286	15.98
6	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	56,288,185	1.2295 69,206,323	1.2211 68,733,502	15.75

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.65%
合計	98.65%

(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 16 特定期間末 (2014 年 3 月 6 日)	1,885,679,377	1,888,027,488	0.8031	0.8041
第 17 特定期間末 (2014 年 9 月 8 日)	1,730,255,928	1,732,293,672	0.8491	0.8501
第 18 特定期間末 (2015 年 3 月 6 日)	1,448,031,765	1,449,549,957	0.9538	0.9548
第 19 特定期間末 (2015 年 9 月 7 日)	1,142,131,200	1,143,425,179	0.8827	0.8837
第 20 特定期間末 (2016 年 3 月 7 日)	1,038,896,216	1,040,066,252	0.8879	0.8889
第 21 特定期間末 (2016 年 9 月 6 日)	937,974,850	939,047,761	0.8742	0.8752
第 22 特定期間末 (2017 年 3 月 6 日)	898,192,319	899,171,681	0.9171	0.9181
第 23 特定期間末 (2017 年 9 月 6 日)	794,987,775	795,852,695	0.9191	0.9201
第 24 特定期間末 (2018 年 3 月 6 日)	747,130,182	747,931,831	0.9320	0.9330
第 25 特定期間末 (2018 年 9 月 6 日)	680,898,712	681,604,088	0.9653	0.9663
第 26 特定期間末 (2019 年 3 月 6 日)	655,753,855	656,435,376	0.9622	0.9632
第 27 特定期間末 (2019 年 9 月 6 日)	634,628,538	635,271,477	0.9871	0.9881
第 28 特定期間末 (2020 年 3 月 6 日)	594,366,801	594,972,530	0.9812	0.9822
第 29 特定期間末 (2020 年 9 月 7 日)	600,840,173	601,433,907	1.0120	1.0130
第 30 特定期間末 (2021 年 3 月 8 日)	585,738,251	586,272,281	1.0968	1.0978
第 31 特定期間末 (2021 年 9 月 6 日)	549,023,959	549,517,287	1.1129	1.1139
第 32 特定期間末 (2022 年 3 月 7 日)	469,207,049	469,676,512	0.9995	1.0005
第 33 特定期間末 (2022 年 9 月 6 日)	471,718,246	472,171,409	1.0409	1.0419
2022 年 9 月末日	450,764,742	—	0.9966	—

	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)
10 月末日	460,735,710	—	1.0387	—
11 月末日	449,281,118	—	1.0255	—
12 月末日	428,068,933	—	0.9770	—
2023 年 1 月末日	435,919,869	—	0.9948	—
2 月末日	437,873,572	—	1.0035	—
第 34 特定期間末 (2023 年 3 月 6 日)	438,763,977	439,200,307	1.0056	1.0066
3 月末日	424,774,368	—	0.9941	—
4 月末日	431,791,054	—	1.0163	—
5 月末日	440,491,855	—	1.0408	—
6 月末日	455,526,386	—	1.0830	—
7 月末日	450,182,446	—	1.0839	—
8 月末日	449,071,678	—	1.0977	—
第 35 特定期間末 (2023 年 9 月 6 日)	450,513,517	450,922,609	1.1013	1.1023
9 月末日	436,270,083	—	1.0689	—

## ② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第 16 特定期間	0.0060
第 17 特定期間	0.0060
第 18 特定期間	0.0060
第 19 特定期間	0.0060
第 20 特定期間	0.0060
第 21 特定期間	0.0060
第 22 特定期間	0.0060
第 23 特定期間	0.0060
第 24 特定期間	0.0060
第 25 特定期間	0.0060
第 26 特定期間	0.0060
第 27 特定期間	0.0060
第 28 特定期間	0.0060
第 29 特定期間	0.0060
第 30 特定期間	0.0060
第 31 特定期間	0.1050
第 32 特定期間	0.0450
第 33 特定期間	0.0060
第 34 特定期間	0.0060
第 35 特定期間	0.0060

## ③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 16 特定期間	11.3
第 17 特定期間	6.5
第 18 特定期間	13.0
第 19 特定期間	△6.8
第 20 特定期間	1.3
第 21 特定期間	△0.9
第 22 特定期間	5.6
第 23 特定期間	0.9
第 24 特定期間	2.1
第 25 特定期間	4.2
第 26 特定期間	0.3
第 27 特定期間	3.2
第 28 特定期間	0.0
第 29 特定期間	3.8
第 30 特定期間	9.0
第 31 特定期間	11.0
第 32 特定期間	△6.1
第 33 特定期間	4.7
第 34 特定期間	△2.8
第 35 特定期間	10.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 16 特定期間	1,260,298	356,162,054
第 17 特定期間	802,846	311,169,491
第 18 特定期間	2,295,000	521,846,915
第 19 特定期間	457,336	224,670,617
第 20 特定期間	418,072	124,361,343
第 21 特定期間	408,623	97,533,399
第 22 特定期間	383,746	93,932,413
第 23 特定期間	357,041	114,799,683
第 24 特定期間	309,332	63,579,762
第 25 特定期間	259,333	96,532,324
第 26 特定期間	364,100	24,219,738
第 27 特定期間	252,406	38,833,447
第 28 特定期間	247,300	37,458,012
第 29 特定期間	328,501	12,322,848
第 30 特定期間	243,967	59,948,825
第 31 特定期間	3,165,877	43,867,869
第 32 特定期間	1,526,775	25,391,728
第 33 特定期間	209,791	16,509,260
第 34 特定期間	196,287	17,029,841
第 35 特定期間	192,804	27,430,892

(参考) マザーファンド  
 ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	13,627,732,195	83.04
内 ユーロ	3,498,552,712	21.32
内 ノルウェー	69,213,991	0.42
内 スウェーデン	291,052,280	1.77
内 デンマーク	548,634,295	3.34
内 イギリス	1,911,821,129	11.65
内 ポーランド	1,312,991,883	8.00
内 カナダ	1,053,163,944	6.42
内 アメリカ	3,963,657,570	24.15
内 オーストラリア	978,644,391	5.96
特殊債券	2,228,897,144	13.58
内 ユーロ	528,690,120	3.22
内 カナダ	997,587,392	6.08
内 オーストラリア	702,619,632	4.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	554,149,808	3.38
純資産総額	16,410,779,147	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)	733,433,429	4.47
内 日本	733,433,429	4.47
為替予約取引(売建)	724,046,920	△4.41
内 日本	724,046,920	△4.41

(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9月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	19,807,400	83.50 2,474,137,788	77.76 2,304,014,337	0.875000 2030/11/15	14.04

	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 (%)
2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	93.35 1,347,568,222	90.76 1,310,196,318	1.400000 2028/04/30	7.98
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,210,400	102.43 1,005,087,409	90.15 884,639,806	3.250000 2045/05/25	5.39
4	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	86.21 734,392,714	90.17 768,185,801	2.750000 2028/04/25	4.68
5	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,900,000	111.22 737,221,499	100.50 666,154,582	4.500000 2033/04/21	4.06
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,686,000	66.99 770,188,185	56.88 654,002,345	1.125000 2040/08/15	3.99
7	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	7,046,000	84.64 660,478,566	77.64 605,843,778	0.500000 2030/12/01	3.69
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,107,800	94.77 582,339,987	91.34 561,252,243	2.250000 2027/08/15	3.42
9	EUROPEAN INVESTMENT BANK	ユーロ	特殊債券	3,500,000	98.37 544,001,426	95.60 528,690,120	2.750000 2030/07/30	3.22
10	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	91.80 536,246,855	87.59 511,609,686	1.625000 2028/10/22	3.12
11	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,230,000	96.71 453,023,530	94.35 441,987,315	2.250000 2025/12/15	2.69
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,520,000	94.30 433,793,788	92.10 423,637,527	1.500000 2026/07/22	2.58
13	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	97.88 418,980,715	96.94 414,969,999	1.750000 2025/11/15	2.53
14	INTL. FIN. CORP.	オーストラリア	特殊債券	5,600,000	80.37 432,377,106	76.86 413,489,885	1.250000 2031/02/06	2.52
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	77.70 439,078,412	72.52 409,802,750	0.250000 2031/07/31	2.50
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,250,000	71.16 452,401,532	61.36 390,119,224	2.250000 2052/02/15	2.38
17	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,260,000	97.79 349,217,098	96.00 342,818,224	1.950000 2026/04/30	2.09
18	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,100,000	64.12 375,773,463	53.32 312,489,808	1.750000 2051/06/21	1.90
19	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	3,000,000	102.50 340,528,822	92.74 308,104,150	3.550000 2032/09/15	1.88
20	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,950,000	108.18 333,302,580	96.10 296,108,748	3.750000 2045/06/22	1.80
21	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,600,000	67.72 278,195,814	61.65 253,258,200	1.200000 2040/10/31	1.54
22	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,400,000	101.74 270,414,677	93.12 247,495,926	3.650000 2033/06/15	1.51
23	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	2,500,000	91.31 219,292,972	89.35 214,576,426	1.100000 2026/12/16	1.31



	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 (%)
24	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	2,200,000	95.08 231,656,230	81.56 198,712,741	2.750000 2048/12/01	1.21
25	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,000,000	90.17 184,348,236	93.76 191,702,130	0.750000 2025/04/25	1.17
26	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	98.82 184,409,676	99.73 186,094,626	1.500000 2023/11/13	1.13
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,400,000	78.77 174,239,240	74.56 164,939,992	— 2032/05/25	1.01
28	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	106.95 195,221,310	90.17 164,587,301	4.250000 2046/12/07	1.00
29	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	5,000,000	93.14 158,698,882	95.36 162,477,711	3.750000 2027/05/25	0.99
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	900,000	107.43 176,494,280	98.64 162,051,046	4.250000 2032/06/07	0.99

(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	83.04%
特殊債券	13.58%
合計	96.62%

(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	ノルウェー・クローネ買/ 円売 2023年10月	買建	22,000,000	303,740,528	305,102,600	1.86%
		米ドル買/円売 2023年10月	買建	2,132,676	316,460,000	317,333,658	1.93%
		豪ドル買/円売 2023年10月	買建	1,160,354	110,761,000	110,997,171	0.68%
		ポーランド・ズロチ売/円 買 2023年10月	売建	8,843,369	303,740,528	299,116,330	△1.82%
		ユーロ売/円買 2023年10月	売建	2,700,000	427,221,000	424,930,590	△2.59%

(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。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	98,027,118,510	99.45
内 日本	98,027,118,510	99.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	543,994,765	0.55
純資産総額	98,571,113,275	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9月29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	16 30年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	119.64 4,665,960,000	117.14 4,568,460,000	2.500000 2034/09/20	4.63
2	20 30年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	120.24 4,569,120,000	117.66 4,471,346,000	2.500000 2035/09/20	4.54
3	27 30年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	121.48 4,373,406,000	118.23 4,256,568,000	2.500000 2037/09/20	4.32
4	24 30年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	120.89 4,352,112,000	117.96 4,246,632,000	2.500000 2036/09/20	4.31
5	12 30年国債	日本	国債証券	3,700,000,000	114.96 4,253,520,000	112.67 4,169,012,000	2.100000 2033/09/20	4.23
6	140 20年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	110.55 4,200,900,000	108.66 4,129,308,000	1.700000 2032/09/20	4.19
7	130 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	110.89 3,992,040,000	109.12 3,928,464,000	1.800000 2031/09/20	3.99
8	94 20年国債	日本	国債証券	3,600,000,000	107.98 3,887,424,000	106.73 3,842,496,000	2.100000 2027/03/20	3.90
9	101 20年国債	日本	国債証券	3,460,000,000	110.93 3,838,247,200	109.41 3,785,828,200	2.400000 2028/03/20	3.84
10	86 20年国債	日本	国債証券	3,400,000,000	106.89 3,634,444,000	105.49 3,586,864,000	2.300000 2026/03/20	3.64
11	121 20年国債	日本	国債証券	3,200,000,000	110.91 3,549,172,000	109.42 3,501,600,000	1.900000 2030/09/20	3.55
12	75 20年国債	日本	国債証券	3,374,000,000	104.33 3,520,262,900	103.08 3,478,155,380	2.100000 2025/03/20	3.53
13	70 20年国債	日本	国債証券	3,338,000,000	103.15 3,443,242,000	101.78 3,397,683,440	2.400000 2024/06/20	3.45

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
14	110 20年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	110.83 3,325,140,000	109.41 3,282,300,000	2.100000 2029/03/20	3.33
15	29 30年国債	日本	国債証券	2,800,000,000	117.34 3,285,632,000	116.93 3,274,096,000	2.400000 2038/09/20	3.32
16	1 30年国債	日本	国債証券	2,850,000,000	116.03 3,306,873,000	114.08 3,251,451,000	2.800000 2029/09/20	3.30
17	80 20年国債	日本	国債証券	3,073,000,000	104.85 3,222,056,500	103.58 3,183,105,590	2.100000 2025/06/20	3.23
18	68 20年国債	日本	国債証券	3,125,000,000	102.31 3,197,203,500	101.09 3,159,343,750	2.200000 2024/03/20	3.21
19	28 30年国債	日本	国債証券	2,600,000,000	122.86 3,194,558,000	118.28 3,075,280,000	2.500000 2038/03/20	3.12
20	88 20年国債	日本	国債証券	2,860,000,000	107.43 3,072,498,000	106.00 3,031,600,000	2.300000 2026/06/20	3.08
21	116 20年国債	日本	国債証券	2,700,000,000	113.17 3,055,794,000	111.06 2,998,620,000	2.200000 2030/03/20	3.04
22	106 20年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	111.11 2,777,898,000	109.24 2,731,125,000	2.200000 2028/09/20	2.77
23	95 20年国債	日本	国債証券	2,505,000,000	109.24 2,736,462,000	107.84 2,701,467,150	2.300000 2027/06/20	2.74
24	134 20年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	111.31 2,671,560,000	109.35 2,624,544,000	1.800000 2032/03/20	2.66
25	125 20年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	113.67 2,614,548,000	111.82 2,572,044,000	2.200000 2031/03/20	2.61
26	143 20年国債	日本	国債証券	2,200,000,000	112.07 2,465,570,000	107.93 2,374,658,000	1.600000 2033/03/20	2.41
27	26 30年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	119.86 2,397,200,000	116.81 2,336,380,000	2.400000 2037/03/20	2.37
28	19 30年国債	日本	国債証券	1,800,000,000	117.74 2,119,320,000	115.32 2,075,850,000	2.300000 2035/06/20	2.11
29	15 30年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	119.49 1,911,840,000	117.00 1,872,128,000	2.500000 2034/06/20	1.90
30	22 30年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	123.51 1,852,710,000	117.79 1,766,955,000	2.500000 2036/03/20	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
国債証券	99.45%
合計	99.45%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,300,922,644	99.22
	内 香港	961,615	0.07
	内 デンマーク	17,946,871	1.37
	内 イギリス	16,523,546	1.26
	内 オランダ	13,053,960	1.00
	内 フランス	32,435,070	2.47
	内 ドイツ	23,333,219	1.78
	内 スイス	22,559,253	1.72
	内 スペイン	4,843,174	0.37
	内 アメリカ	1,161,684,552	88.60
	内 オーストラリア	7,581,384	0.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		10,200,051	0.78
純資産総額		1,311,122,695	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9月29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	3,190	28,375.32 90,517,290	25,531.81 81,446,475	6.21
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,555	49,892.40 77,582,696	46,914.27 72,951,692	5.56
3	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	2,500	20,449.08 51,122,705	19,913.58 49,783,964	3.80
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	730	72,618.09 53,011,212	64,452.52 47,050,344	3.59
5	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,300	20,532.84 47,225,547	18,844.08 43,341,403	3.31
6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	675	45,123.64 30,458,548	45,466.33 30,689,777	2.34

	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 (%)
7	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	1,500	16,981.81 25,472,726	17,870.32 26,805,484	2.04
8	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	300	83,494.06 25,048,218	81,438.83 24,431,649	1.86
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	660	38,365.77 25,321,411	36,853.52 24,323,323	1.86
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	910	21,719.01 19,764,305	22,076.51 20,089,626	1.53
11	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	330	61,552.17 20,312,216	59,748.23 19,716,918	1.50
12	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	550	36,697.95 20,183,876	34,651.70 19,058,437	1.45
13	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	600	32,711.65 19,626,990	30,394.65 18,236,794	1.39
14	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	1,300	14,023.54 18,230,605	13,805.28 17,946,871	1.37
15	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	140	130,459.18 18,264,286	124,450.56 17,423,078	1.33
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	325	53,919.10 17,523,708	53,409.03 17,357,936	1.32
17	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	208	72,581.75 15,097,035	76,300.75 15,870,558	1.21
18	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	695	22,801.97 15,847,373	21,889.53 15,213,228	1.16
19	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	150	97,865.20 14,679,780	87,026.40 13,053,960	1.00
20	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・サ ービス	400	34,339.08 13,735,632	32,238.97 12,895,591	0.98
21	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	145	81,480.71 11,814,703	85,055.67 12,333,073	0.94
22	KKR & CO INC	アメリカ	株式	金融	1,300	9,330.05 12,129,083	9,356.22 12,163,098	0.93
23	SYNOPSIS INC	アメリカ	株式	情報技術	175	69,831.42 12,220,499	68,913.00 12,059,775	0.92
24	TJX COMPANIES INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	900	13,704.51 12,334,068	13,399.37 12,059,439	0.92
25	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	145	89,323.19 12,951,863	82,795.52 12,005,351	0.92
26	LINDE PLC	アメリカ	株式	素材	210	57,363.48 12,046,346	55,866.63 11,731,993	0.89
27	CONOCOPHILLIPS	アメリカ	株式	エネルギー	630	18,372.91 11,574,934	18,356.45 11,564,568	0.88
28	ASTRAZENECA PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	575	19,596.42 11,267,942	20,089.25 11,551,320	0.88

	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	CADENCE DESIGN SYS INC	アメリカ	株式	情報技術	325	36,723.38 11,935,100	35,003.21 11,376,045	0.87
30	APPLIED MATERIALS INC	アメリカ	株式	情報技術	550	22,976.98 12,637,341	20,674.94 11,371,221	0.87

(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	99.22%
合計	99.22%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.02%
素材	1.80%
資本財・サービス	9.52%
一般消費財・サービス	12.94%
生活必需品	5.69%
ヘルスケア	13.49%
金融	12.99%
情報技術	30.30%
コミュニケーション・サービス	7.77%
公益事業	0.70%
合計	99.22%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,287,461,750	97.73
内 日本	1,287,461,750	97.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29,869,758	2.27
純資産総額	1,317,331,508	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9月29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	44,900	2,651.00 119,029,900	2,677.50 120,219,750	9.13
2	日立	日本	株式	電気機器	7,500	10,140.00 76,050,000	9,275.00 69,562,500	5.28
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	5,600	12,690.00 71,064,000	12,240.00 68,544,000	5.20
4	任天堂	日本	株式	その他製品	9,400	6,323.00 59,436,200	6,230.00 58,562,000	4.45
5	デンソー	日本	株式	輸送用機器	22,800	2,583.75 58,909,500	2,401.00 54,742,800	4.16
6	アシックス	日本	株式	その他製品	10,200	5,369.00 54,763,800	5,223.00 53,274,600	4.04
7	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	39,800	1,230.00 48,954,000	1,268.50 50,486,300	3.83
8	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	2,400	22,115.00 53,076,000	20,440.00 49,056,000	3.72
9	味の素	日本	株式	食料品	8,400	6,100.00 51,240,000	5,764.00 48,417,600	3.68
10	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	10,500	5,339.00 56,059,500	4,609.00 48,394,500	3.67
11	ディスコ	日本	株式	機械	1,600	28,680.00 45,888,000	27,580.00 44,128,000	3.35
12	第一三共	日本	株式	医薬品	9,700	4,221.00 40,943,700	4,106.00 39,828,200	3.02
13	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	8,100	5,287.00 42,824,700	4,909.00 39,762,900	3.02



	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
14	信越化学	日本	株式	化学	9,000	4,764.00 42,876,000	4,343.00 39,087,000	2.97
15	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	5,300	7,002.00 37,110,600	7,347.00 38,939,100	2.96
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	215,500	169.10 36,441,050	176.60 38,057,300	2.89
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	1,600	26,125.00 41,800,000	23,475.00 37,560,000	2.85
18	住友電工	日本	株式	非鉄金属	19,400	1,840.00 35,696,000	1,801.50 34,949,100	2.65
19	村田製作所	日本	株式	電気機器	11,100	2,846.66 31,598,000	2,734.00 30,347,400	2.30
20	大和ハウス	日本	株式	建設業	7,500	4,097.00 30,727,500	4,015.00 30,112,500	2.29
21	イビデン	日本	株式	電気機器	3,700	9,264.00 34,276,800	7,964.00 29,466,800	2.24
22	野村総合研究所	日本	株式	情報・通信 業	7,500	4,286.00 32,145,000	3,893.00 29,197,500	2.22
23	ユニ・チャーム	日本	株式	化学	5,300	5,689.91 30,156,537	5,291.00 28,042,300	2.13
24	キーエンス	日本	株式	電気機器	500	60,720.00 30,360,000	55,500.00 27,750,000	2.11
25	東京海上HD	日本	株式	保険業	7,900	3,340.00 26,386,000	3,465.00 27,373,500	2.08
26	テルモ	日本	株式	精密機器	5,200	4,374.00 22,744,800	3,963.00 20,607,600	1.56
27	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	600	34,110.00 20,466,000	32,590.00 19,554,000	1.48
28	日産化学	日本	株式	化学	2,900	6,302.00 18,275,800	6,359.00 18,441,100	1.40
29	三井不動産	日本	株式	不動産業	5,500	3,410.00 18,755,000	3,294.00 18,117,000	1.38
30	HOYA	日本	株式	精密機器	1,100	16,630.00 18,293,000	15,325.00 16,857,500	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.73%
合計	97.73%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	2.29%

業種	投資比率
食料品	3.68%
化学	8.22%
医薬品	3.02%
非鉄金属	2.65%
機械	6.71%
電気機器	21.36%
輸送用機器	13.28%
精密機器	2.84%
その他製品	9.60%
情報・通信業	5.66%
小売業	1.48%
銀行業	6.79%
保険業	2.08%
不動産業	1.38%
サービス業	6.69%
合計	97.73%

(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・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	85,788,025,394	98.35
内 香港	2,554,857,835	2.93
内 シンガポール	7,372,906,611	8.45
内 イギリス	8,297,024,136	9.51
内 オランダ	646,882,399	0.74
内 ベルギー	2,499,034,433	2.86
内 フランス	3,448,323,749	3.95
内 スペイン	1,088,752,704	1.25
内 カナダ	2,765,224,032	3.17
内 アメリカ	42,524,005,070	48.75
内 オーストラリア	13,717,729,448	15.73
内 ニュージーランド	873,284,977	1.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,438,825,419	1.65
純資産総額	87,226,850,813	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)	32,731,664	0.04
内 日本	32,731,664	0.04
為替予約取引(売建)	32,742,754	△0.04
内 日本	32,742,754	△0.04

(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9月29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	2,379,494	2,170.95 5,165,776,776	2,072.97 4,932,631,099	5.65
2	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	238,359	18,597.28 4,432,829,397	16,772.40 3,997,853,779	4.58

	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	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	311,476	12,641.00 3,937,369,923	12,035.20 3,748,678,073	4.30
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	213,319	17,557.70 3,745,391,092	16,278.79 3,472,575,503	3.98
5	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	668,615	5,257.73 3,515,401,824	4,750.66 3,176,363,071	3.64
6	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	175,769	19,218.03 3,377,935,392	17,731.21 3,116,597,613	3.57
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	365,942	8,244.84 3,017,136,752	7,422.15 2,716,079,928	3.11
8	LINK REIT	香港	投資証券	3,618,192	712.80 2,579,058,112	706.11 2,554,857,835	2.93
9	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	20,417	116,996.98 2,388,727,516	107,842.69 2,201,824,255	2.52
10	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	5,083,977	411.64 2,092,792,695	394.12 2,003,737,687	2.30
11	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	101,060	20,637.55 2,085,631,066	19,286.84 1,949,128,576	2.23
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	97,113	18,878.49 1,833,346,974	18,072.25 1,755,050,958	2.01
13	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	94,871	18,915.88 1,794,569,097	17,708.77 1,680,049,307	1.93
14	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	4,398,084	384.24 1,689,919,796	381.35 1,677,245,398	1.92
15	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	836,030	2,195.97 1,835,900,310	1,994.42 1,667,401,139	1.91
16	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,294,929	1,367.87 1,771,307,246	1,284.64 1,663,525,541	1.91
17	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	7,966,400	208.01 1,657,106,797	200.34 1,596,055,494	1.83
18	AMERICOLD REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	346,534	4,886.77 1,693,434,935	4,565.18 1,581,990,641	1.81
19	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,658,463	984.61 1,632,947,547	913.53 1,515,056,699	1.74
20	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	3,668,535	413.05 1,515,317,730	399.60 1,465,981,804	1.68
21	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	103,022	15,469.56 1,593,705,381	14,153.25 1,458,097,111	1.67
22	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,357,580	1,096.09 1,488,154,300	1,049.18 1,424,349,097	1.63
23	UNITE GROUP PLC/THE	イギリス	投資証券	850,181	1,694.79 1,440,879,149	1,611.73 1,370,270,640	1.57
24	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	シンガポール	投資証券	7,262,800	185.13 1,344,717,643	181.73 1,319,918,031	1.51

	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	FRASERS CENTREPOINT TRUST	シンガポール	投資証券	5,594,100	241.95 1,353,496,970	235.38 1,316,750,446	1.51
26	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	アメリカ	投資証券	549,697	2,518.92 1,384,646,725	2,252.67 1,238,288,580	1.42
27	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	投資証券	50,689	27,085.94 1,372,959,537	24,279.82 1,230,720,080	1.41
28	KLEPIERRE	フランス	投資証券	342,991	3,964.22 1,359,691,782	3,588.18 1,230,713,446	1.41
29	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	462,317	2,850.99 1,318,063,363	2,637.09 1,219,174,034	1.40
30	DEXUS/AU	オーストラリア	投資証券	1,710,420	718.52 1,228,986,030	700.27 1,197,768,471	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	98.35%
合計	98.35%

(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10月	買建	218,931	32,755,499	32,731,664	0.04%
		シンガポール・ドル売/円買 2023年10月	売建	299,192	32,755,499	32,742,754	△0.04%

(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9月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	162,545,977,000	96.66
内 日本	162,545,977,000	96.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,610,878,940	3.34
純資産総額	168,156,855,940	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)	3,322,600,000	1.98
内 日本	3,322,600,000	1.98

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年9月29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	23,130	555,322.98 12,844,620,543	606,000.00 14,016,780,000	8.34
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	38,926	305,690.10 11,899,293,048	279,200.00 10,868,139,200	6.46
3	GLP投資法人	日本	投資証券	77,680	149,227.37 11,591,982,753	133,700.00 10,385,816,000	6.18
4	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	33,366	286,414.09 9,556,492,607	263,800.00 8,801,950,800	5.23
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	86,219	98,574.56 8,499,000,383	97,000.00 8,363,243,000	4.97
6	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	10,256	653,757.23 6,704,934,159	631,000.00 6,471,536,000	3.85
7	野村不動産マスターF	日本	投資証券	38,297	159,866.90 6,122,422,749	167,400.00 6,410,917,800	3.81
8	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	74,648	75,359.22 5,625,415,334	78,100.00 5,830,008,800	3.47

	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	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	16,132	348,563.16 5,623,020,957	361,000.00 5,823,652,000	3.46
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	15,570	349,925.96 5,448,347,293	339,000.00 5,278,230,000	3.14
11	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	22,978	211,031.40 4,849,079,742	228,300.00 5,245,877,400	3.12
12	三菱地所物流 REIT	日本	投資証券	13,387	417,892.49 5,594,326,805	375,500.00 5,026,818,500	2.99
13	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	32,121	148,967.36 4,784,980,832	155,700.00 5,001,239,700	2.97
14	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	8,045	541,337.16 4,355,057,502	583,000.00 4,690,235,000	2.79
15	オリックス不動産投資	日本	投資証券	26,049	177,120.47 4,613,811,276	179,400.00 4,673,190,600	2.78
16	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	30,493	159,631.17 4,867,633,331	143,400.00 4,372,696,200	2.60
17	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	14,576	248,600.35 3,623,598,798	289,100.00 4,213,921,600	2.51
18	イオンリート投資	日本	投資証券	27,811	153,950.68 4,281,522,372	146,500.00 4,074,311,500	2.42
19	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,588	338,659.00 3,924,380,498	331,500.00 3,841,422,000	2.28
20	日本リート投資法人	日本	投資証券	8,939	326,846.94 2,921,684,837	357,000.00 3,191,223,000	1.90
21	産業ファンド	日本	投資証券	22,178	151,602.65 3,362,243,759	138,200.00 3,064,999,600	1.82
22	インヴェンシブル投資法人	日本	投資証券	45,891	57,759.88 2,650,658,786	61,800.00 2,836,063,800	1.69
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	18,780	149,239.60 2,802,719,749	141,700.00 2,661,126,000	1.58
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	16,612	154,415.02 2,565,142,353	159,400.00 2,647,952,800	1.57
25	API投資法人	日本	投資証券	5,904	395,163.16 2,333,043,335	412,500.00 2,435,400,000	1.45
26	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	5,204	478,667.86 2,490,987,549	457,500.00 2,380,830,000	1.42
27	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	28,376	78,635.54 2,231,362,211	83,300.00 2,363,720,800	1.41
28	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	668,000.00 1,997,320,000	1.19
29	NTT 都市開発リート投資法人	日本	投資証券	14,124	130,357.35 1,841,167,347	138,100.00 1,950,524,400	1.16
30	Oneリート投資法人	日本	投資証券	6,346	241,030.93 1,529,582,312	259,200.00 1,644,883,200	0.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.66%
合計	96.66%

(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 051 2月	買建	1,796	3,397,681,560	3,322,600,000	1.98%

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

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



(参考情報) 運用実績

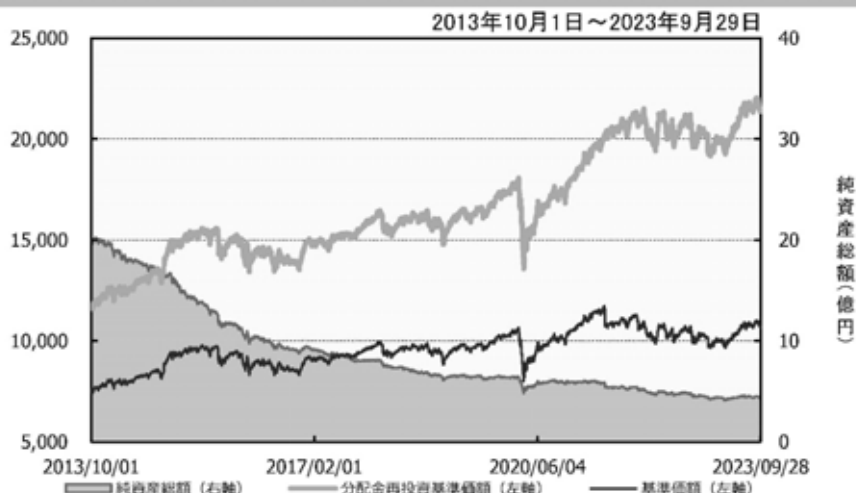
●世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)

2023年9月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,689円
純資産総額	4.3億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.5%
3カ月間	-1.0%
6カ月間	8.1%
1年間	8.5%
3年間	24.3%
5年間	30.4%
設定来	114.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000円当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 120円 設定来分配金合計額: 6,045円

決算期	第196期	第197期	第198期	第199期	第200期	第201期	第202期	第203期	第204期	第205期	第206期	第207期
	22年10月	22年11月	22年12月	23年1月	23年2月	23年3月	23年4月	23年5月	23年6月	23年7月	23年8月	23年9月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

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

主要な資産の状況

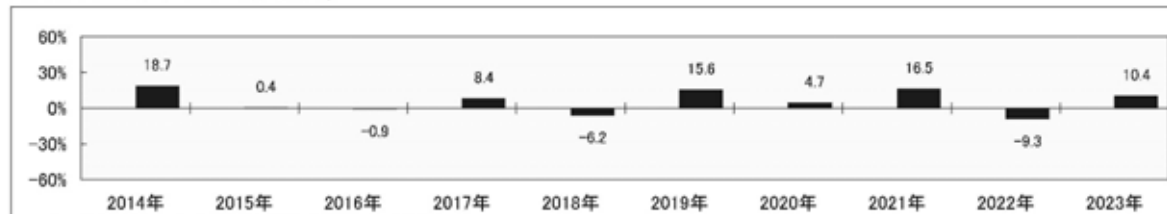
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	36	16.8%	日本円	51.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.6%	
外国株式	142	16.5%	米ドル	27.5%	最終利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	1.0%	
国内リート・先物	48	16.2%	ユーロ	6.1%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%	
外国債券	43	16.0%	豪ドル	4.4%	残存年数	日立	日本	0.9%	
外国リート	69	15.7%	英ポンド	3.8%	債券格付別構成	ソニーグループ	日本	0.9%	
国内債券	31	15.7%	カナダドル	2.6%	AAA	89.5%	日本ビルファンド	日本	1.4%
			シンガポール・ドル	1.2%	AA	6.3%	日本プロロジスリート	日本	1.1%
			ポーランド・ズロチ	1.1%	A	4.2%	GLP投資法人	日本	1.0%
			デンマーク・クローネ	0.8%	BBB	-	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.9%
コール・ローン、その他	3.3%		その他	1.6%	BB	-	大和ハウスリート投資法人	日本	0.9%
合計	369	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	10.6%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。  
 ※格付別構成については、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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
 ・2023年は9月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(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
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	1.47%	1.43%	0.03%

※対象期間は2023年3月7日～2023年9月6日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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、申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

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

<一部解約>

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

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、

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：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：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】

毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年6月28日から2006年7月6日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受

益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

### ③ 反対者の買取請求権

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

### ④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年3月および9月の計算期間の末日ならびに償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

### ⑤ 公告

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

### ⑥ 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

<収益分配金および償還金にかかる請求権>

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

する権利を有します。

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

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

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

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

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

<換金請求権>

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2023年3月7日から2023年9月6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10月20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 公認会計士 秋山 範之  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員

### 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」に掲げられている世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の2023年3月7日から2023年9月6日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の2023年9月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）

(1) 【貸借対照表】

	前期 2023年3月6日現在 金額（円）	当期 2023年9月6日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,207,780	5,246,103
親投資信託受益証券	432,494,994	446,217,323
流動資産合計	439,702,774	451,463,426
資産合計	439,702,774	451,463,426
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	436,330	409,092
未払受託者報酬	18,478	19,946
未払委託者報酬	465,799	502,763
その他未払費用	18,190	18,108
流動負債合計	938,797	949,909
負債合計	938,797	949,909
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	436,330,091	409,092,003
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,433,886	41,421,514
（分配準備積立金）	49,438,830	51,534,098
元本等合計	438,763,977	450,513,517
純資産合計	438,763,977	450,513,517
負債純資産合計	439,702,774	451,463,426

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期 自 2022 年 9 月 7 日 至 2023 年 3 月 6 日 金 額 (円)	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日 金 額 (円)
営業収益		
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	△10,101,958	45,722,329
営業収益合計	△10,101,957	45,722,329
営業費用		
支払利息	1,189	1,040
受託者報酬	121,806	121,300
委託者報酬	※1 3,070,662	3,057,802
その他費用	18,190	18,108
営業費用合計	3,211,847	3,198,250
営業利益又は営業損失 (△)	△13,313,804	42,524,079
経常利益又は経常損失 (△)	△13,313,804	42,524,079
当期純利益又は当期純損失 (△)	△13,313,804	42,524,079
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 (△)	△169,049	△80,238
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	18,554,601	2,433,886
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,621	7,127
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,621	7,127
剰余金減少額又は欠損金増加額	331,902	1,103,431
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	331,902	1,103,431
分配金	※2 2,646,679	2,520,385
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	2,433,886	41,421,514

### (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 2023 年 3 月 6 日現在	当期 2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首元本額	453,163,645 円	436,330,091 円
期中追加設定元本額	196,287 円	192,804 円
期中一部解約元本額	17,029,841 円	27,430,892 円
2. 特定期間末日における受益権の総数	436,330,091 口	409,092,003 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 自 2022 年 9 月 7 日 至 2023 年 3 月 6 日	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 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	179,373 円	179,456 円
2. ※2 分配金の計算過程	<p>(自 2022 年 9 月 7 日至 2022 年 10 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (853,531 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 (3,008,761 円) 及び分配準備積立金 (50,896,733 円) より分配対象額は 54,759,025 円 (1 万口当たり 1,210.72 円) であり、うち 452,285 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>	<p>(自 2023 年 3 月 7 日至 2023 年 4 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (891,841 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 (2,864,247 円) 及び分配準備積立金 (48,411,047 円) より分配対象額は 52,167,135 円 (1 万口当たり 1,220.88 円) であり、うち 427,291 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>

区分	前期 自 2022 年 9 月 7 日 至 2023 年 3 月 6 日	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
	<p>(自 2022 年 10 月 7 日至 2022 年 11 月 7 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (305,631 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 (2,954,476 円) 及び分配準備積立金 (50,306,960 円) より分配対象額は 53,567,067 円 (1 万口当たり 1,207.61 円) であり、うち 443,579 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p> <p>(自 2022 年 11 月 8 日至 2022 年 12 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (280,794 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 (2,921,810 円) 及び分配準備積立金 (49,548,951 円) より分配対象額は 52,751,555 円 (1 万口当たり 1,204.02 円) であり、うち 438,129 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>	<p>(自 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 5 月 8 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (555,094 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 (2,851,802 円) 及び分配準備積立金 (48,593,656 円) より分配対象額は 52,000,552 円 (1 万口当たり 1,223.95 円) であり、うち 424,860 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p> <p>(自 2023 年 5 月 9 日至 2023 年 6 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (740,448 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 (2,844,514 円) 及び分配準備積立金 (48,532,141 円) より分配対象額は 52,117,103 円 (1 万口当たり 1,231.44 円) であり、うち 423,220 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>

区分	前期 自 2022 年 9 月 7 日 至 2023 年 3 月 6 日	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
	<p>(自 2022 年 12 月 7 日至 2023 年 1 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (337,747 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 (2,925,730 円) 及び分配準備積立金 (49,391,616 円) より分配対象額は 52,655,093 円 (1 万口当たり 1,201.73 円) であり、うち 438,161 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p> <p>(自 2023 年 1 月 7 日至 2023 年 2 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (613,368 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 (2,929,801 円) 及び分配準備積立金 (49,291,202 円) より分配対象額は 52,834,371 円 (1 万口当たり 1,205.72 円) であり、うち 438,195 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>	<p>(自 2023 年 6 月 7 日至 2023 年 7 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,020,463 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 (2,830,564 円) 及び分配準備積立金 (48,543,705 円) より分配対象額は 52,394,732 円 (1 万口当たり 1,245.70 円) であり、うち 420,603 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p> <p>(自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 8 月 7 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (101,816 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 (2,798,560 円) 及び分配準備積立金 (48,522,639 円) より分配対象額は 51,423,015 円 (1 万口当たり 1,238.15 円) であり、うち 415,319 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>

区分	前期 自 2022 年 9 月 7 日 至 2023 年 3 月 6 日	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
	<p>(自 2023 年 2 月 7 日至 2023 年 3 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (623,116 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 (2,921,027 円) 及び分配準備積立金 (49,252,044 円) より分配対象額は 52,796,187 円 (1 万口当たり 1,210.01 円) であり、うち 436,330 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>	<p>(自 2023 年 8 月 8 日至 2023 年 9 月 6 日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,089,167 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 (3,371,418 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,760,224 円) 及び分配準備積立金 (47,482,605 円) より分配対象額は 54,703,414 円 (1 万口当たり 1,337.19 円) であり、うち 409,092 円 (1 万口当たり 10 円) を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	当期 自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項



区分	当期
	2023年9月6日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△2,059,198	12,909,900
合計	△2,059,198	12,909,900

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期	当期
2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期
自 2023年3月7日
至 2023年9月6日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期	当期
	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額	1.0056円	1.1013円
(1万口当たり純資産額)	(10,056円)	(11,013円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	37,544,149	73,522,706	
	ダイワ日本国債マザーファンド	56,288,185	69,206,323	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	19,430,802	73,359,049	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	20,845,419	74,628,684	
	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	39,734,806	79,088,157	
	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	16,548,078	76,412,404	
親投資信託受益証券 合計			446,217,323	
合計			446,217,323	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	114,329,521	102,919,328
コール・ローン	33,366,510	27,892,717
国債証券	14,770,487,582	14,074,326,882
特殊債券	1,199,417,421	2,234,426,523
派生商品評価勘定	5,313,803	7,826,208
未収利息	147,747,686	104,549,061
前払費用	7,070,867	3,639,396
差入委託証拠金	152,694,655	169,723,984
流動資産合計	16,430,428,045	16,725,304,099
資産合計	16,430,428,045	16,725,304,099
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,519,990	288,430
未払解約金	9,696,039	33,058,680
流動負債合計	19,216,029	33,347,110
負債合計	19,216,029	33,347,110
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	9,156,762,595	8,523,703,703
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,254,449,421	8,168,253,286
元本等合計	16,411,212,016	16,691,956,989
純資産合計	16,411,212,016	16,691,956,989
負債純資産合計	16,430,428,045	16,725,304,099

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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	9,528,389,771 円	9,156,762,595 円
期中追加設定元本額	110,016,472 円	176,410,394 円
期中一部解約元本額	481,643,648 円	809,469,286 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ FOFs 用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,224,135,313 円	1,211,900,440 円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	555,704,335 円	526,905,044 円

区分	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	43,634,899 円	42,554,782 円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	143,992,562 円	143,039,131 円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	225,641,154 円	222,864,942 円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	316,183,655 円	311,865,721 円
6資産バランスファンド（分配型）	706,667,718 円	692,333,671 円
6資産バランスファンド（成長型）	99,393,396 円	98,430,725 円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	3,566,551,919 円	3,237,304,033 円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	39,157,184 円	37,544,149 円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	143,296,653 円	133,445,443 円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	648,242,716 円	639,672,290 円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	154,122,362 円	-円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	651,279,440 円	626,471,303 円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	23,473,893 円	12,999,879 円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	506,150,458 円	485,533,181 円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	109,134,938 円	100,838,969 円
計	9,156,762,595 円	8,523,703,703 円
2. 期末日における受益権の総数	9,156,762,595 口	8,523,703,703 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 2023年3月7日 至 2023年9月6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。

区分	自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 6 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	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
国債証券	71,852,950	△719,672,564
特殊債券	△8,547,719	△65,691,389
合計	63,305,231	△785,363,953

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年3月6日現在				2023年9月6日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	671,682,282	-	680,536,390	△8,854,108	729,358,254	-	724,526,592	4,831,662
ポーランド・ズロチ	287,715,282	-	291,310,600	△3,595,318	301,327,254	-	297,823,182	3,504,072
ユーロ	383,967,000	-	389,225,790	△5,258,790	428,031,000	-	426,703,410	1,327,590
買建	671,682,282	-	676,330,203	4,647,921	729,358,254	-	732,064,370	2,706,116
アメリカ・ドル	284,420,000	-	289,252,195	4,832,195	317,060,000	-	319,453,800	2,393,800
オーストラリア・ドル	99,547,000	-	100,028,608	481,608	110,971,000	-	110,682,570	△288,430
ノルウェー・クローネ	287,715,282	-	287,049,400	△665,882	301,327,254	-	301,928,000	600,746
合計	1,343,364,564	-	1,356,866,593	△4,206,187	1,458,716,508	-	1,456,590,962	7,537,778

(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3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額	1.7923円	1.9583円
(1万口当たり純資産額)	(17,923円)	(19,583円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	4,107,800.000	3,776,588.080	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	7,686,000.000	4,601,838.780	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	19,807,400.000	15,700,335.610	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	4,250,000.000	2,776,100.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	400,000.000	371,812.000	
アメリカ・ドル 小計				27,226,674.470 (4,025,736,088)	
イギリス・ポンド		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	2,520,000.000	2,305,245.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	2,784,800.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,400,000.000	528,808.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,239,150.760	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	835,074.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	900,000.000	889,335.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	921,130.000	
イギリス・ポンド 小計				10,503,543.360 (1,949,982,824)	
オーストラリア・ドル		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	6,900,000.000	7,107,759.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	6,100,000.000	3,441,376.000	
オーストラリア・ドル 小計				10,549,135.000 (992,779,095)	
カナダ・ドル		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,475,760.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	2,200,000.000	1,904,782.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	7,046,000.000	5,606,290.820	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	872,370.000	
カナダ・ドル 小計				9,859,202.820 (1,068,244,625)	
スウェーデン・クローナ		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	13,630,000.000	13,573,162.900	



種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	8,230,000.000	7,707,312.700	
	スウェーデン・クローナ 小計			21,280,475.600 (283,455,935)	
	デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	6,597,305.000	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	19,642,480.000	
	デンマーク・クローネ 小計			26,239,785.000 (557,857,830)	
	ノルウェー・ク ローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	5,000,000.000	4,968,700.000	
	ノルウェー・クローネ 小計			4,968,700.000 (68,418,999)	
	ポーランド・ズ ロチ	2.25% Poland Government Bond 20241025	1,500,000.000	1,448,910.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	6,000,000.000	5,581,800.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	5,500,000.000	4,175,105.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	5,000,000.000	4,741,600.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	22,442,500.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			38,389,915.000 (1,354,446,108)	
	ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	667,248.650	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	6,210,400.000	5,958,568.280	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,032,171.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,400,000.000	1,078,238.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,950,000.000	2,002,045.500	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	3,060,000.000	2,955,470.400	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	8,413,433.760	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	2,600,000.000	1,705,808.000	
	ユーロ 小計			23,812,983.590 (3,773,405,378)	
国債証券 合計				14,074,326,882 [14,074,326,882]	
特殊債券	オーストラリ ア・ドル	4.3% SWEDISH EXPORT CREDIT 20280530	800,000.000	785,352.000	
		1.25% INTL. FIN. CORP. 20310206	5,600,000.000	4,375,784.000	
		1.1% AFRICAN DEVELOPMENT BK. 20261216	2,500,000.000	2,247,175.000	
	オーストラリア・ドル 小計			7,408,311.000 (697,196,148)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	カナダ・ドル	2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	4,230,000.000	4,005,852.300	
		3.55% CANADA HOUSING TRUST 20320915	3,000,000.000	2,867,640.000	
		3.65% CANADA HOUSING TRUST 20330615	2,400,000.000	2,307,912.000	
	カナダ・ドル 小計			9,181,404.300 (994,805,156)	
	ユーロ	2.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20300730	3,500,000.000	3,423,105.000	
	ユーロ 小計			3,423,105.000 (542,425,219)	
特殊債券 合計				2,234,426,523 [2,234,426,523]	
合計				16,308,753,405 [16,308,753,405]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 5 銘柄	100%	24.7%
イギリス・ポンド	国債証券 7 銘柄	100%	12.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 2 銘柄	100%	10.4%
	特殊債券 3 銘柄		
カナダ・ドル	国債証券 4 銘柄	100%	12.6%
	特殊債券 3 銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 2 銘柄	100%	1.7%
デンマーク・クローネ	国債証券 2 銘柄	100%	3.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1 銘柄	100%	0.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 5 銘柄	100%	8.3%
ユーロ	国債証券 8 銘柄	100%	26.5%
	特殊債券 1 銘柄		

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況  
 以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	386,972,575	262,442,358
国債証券	110,063,043,640	100,358,802,490
未収利息	805,633,089	799,562,201
前払費用	6,178,079	30,610,402
流動資産合計	111,261,827,383	101,451,417,451
資産合計	111,261,827,383	101,451,417,451
負債の部		
流動負債		
未払解約金	268,131,455	33,717,820
流動負債合計	268,131,455	33,717,820
負債合計	268,131,455	33,717,820
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	90,569,331,391	82,485,260,887
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	20,424,364,537	18,932,438,744
元本等合計	110,993,695,928	101,417,699,631
純資産合計	110,993,695,928	101,417,699,631
負債純資産合計	111,261,827,383	101,451,417,451

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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	100,756,021,737 円	90,569,331,391 円
期中追加設定元本額	423,365,868 円	367,673,159 円
期中一部解約元本額	10,610,056,214 円	8,451,743,663 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドV A (適格機関投資家専用)	33,604 円	40,632 円
安定重視ポートフォリオ (奇数 月分配型)	210,945,635 円	227,932,829 円
6 資産バランスファンド (分配 型)	203,800,475 円	207,849,397 円
6 資産バランスファンド (成長 型)	147,082,809 円	147,930,948 円
ダイワ日本国債ファンド (毎月 分配型)	83,282,963,462 円	76,283,328,572 円
世界 6 資産均等分散ファンド (毎月分配型)	58,716,298 円	56,288,185 円
ダイワ・株/債券/コモディテ ィ・バランスファンド	32,652,661 円	-円
ダイワ日本国債ファンド (年 1 回決算型)	6,627,414,375 円	5,489,581,465 円
目標利回り追求型債券ファンド	5,722,072 円	72,308,859 円
計	90,569,331,391 円	82,485,260,887 円
2. 期末日における受益権の総数	90,569,331,391 口	82,485,260,887 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 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 6 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	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△4,435,039,960	△1,086,610,610
合計	△4,435,039,960	△1,086,610,610

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 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)

	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,225円 (12,255円)	1,229円 (12,295円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	1 30年国債	3,250,000,000	3,733,860,000	
	1 2 30年国債	4,100,000,000	4,671,048,000	
	1 5 30年国債	1,600,000,000	1,893,504,000	
	1 6 30年国債	3,900,000,000	4,621,500,000	
	1 9 30年国債	1,800,000,000	2,102,058,000	
	2 0 30年国債	3,800,000,000	4,526,598,000	
	2 2 30年国債	1,500,000,000	1,790,430,000	
	2 3 30年国債	300,000,000	358,521,000	
	2 4 30年国債	3,600,000,000	4,304,628,000	
	2 6 30年国債	2,000,000,000	2,370,440,000	
	2 7 30年国債	3,600,000,000	4,317,768,000	
	2 8 30年国債	2,000,000,000	2,400,420,000	
	6 8 20年国債	3,125,000,000	3,164,343,750	
	7 0 20年国債	3,338,000,000	3,403,658,460	
	7 5 20年国債	3,374,000,000	3,484,363,540	
	8 0 20年国債	3,073,000,000	3,188,636,990	
	8 6 20年国債	3,400,000,000	3,594,752,000	
	8 8 20年国債	2,860,000,000	3,038,864,400	
	9 4 20年国債	3,600,000,000	3,854,700,000	
	9 5 20年国債	2,505,000,000	2,711,186,550	
	1 0 1 20年国債	3,460,000,000	3,804,373,800	
	1 0 2 20年国債	2,600,000,000	2,870,322,000	
	1 0 6 20年国債	3,200,000,000	3,514,656,000	
	1 1 0 20年国債	3,000,000,000	3,300,990,000	
	1 1 6 20年国債	2,700,000,000	3,021,840,000	
	1 2 1 20年国債	3,800,000,000	4,194,326,000	
	1 2 5 20年国債	2,300,000,000	2,596,033,000	
1 3 0 20年国債	3,600,000,000	3,967,668,000		
1 3 4 20年国債	2,400,000,000	2,652,024,000		
1 4 0 20年国債	4,100,000,000	4,505,859,000		
1 4 3 20年国債	2,200,000,000	2,399,430,000		
国債証券 合計			100,358,802,490	
合計			100,358,802,490	

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

	2023年3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,766,903,493	1,045,387,930
コール・ローン	282,490,453	657,486,602
投資証券	90,305,152,217	90,573,263,065
派生商品評価勘定	55,394	43,092
未収入金	116,194,750	181,162,077
未収配当金	176,550,287	145,729,759
流動資産合計	92,647,346,594	92,603,072,525
資産合計	92,647,346,594	92,603,072,525
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,693	50,258
未払金	336,265,080	57,646,964
未払解約金	80,084,000	69,114,000
流動負債合計	416,359,773	126,811,222
負債合計	416,359,773	126,811,222
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	25,508,106,430	24,494,736,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	66,722,880,391	67,981,525,220
元本等合計	92,230,986,821	92,476,261,303
純資産合計	92,230,986,821	92,476,261,303
負債純資産合計	92,647,346,594	92,603,072,525



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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	26,669,001,515 円	25,508,106,430 円
期中追加設定元本額	616,071,372 円	852,291,901 円

区分	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
期中一部解約元本額	1,776,966,457 円	1,865,662,248 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)	827,530 円	822,979 円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン(毎月分配型)	20,254,997,405 円	18,933,682,945 円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	21,466,791 円	22,227,783 円
安定重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	10,124,057 円	10,482,112 円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	7,821,382 円	8,117,418 円
成長重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	39,888,778 円	40,292,687 円
6資産バランスファンド(分配 型)	71,224,953 円	71,366,695 円
6資産バランスファンド(成長 型)	201,101,802 円	205,667,561 円
りそな ワールド・リート・フ ァンド	938,427,997 円	905,253,195 円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	20,249,371 円	19,430,802 円
常陽3分法ファンド	92,469,284 円	92,947,127 円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	23,227,653 円	22,716,838 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)	44,444,963 円	40,885,327 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)	577,919,714 円	587,052,171 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)	627,879,619 円	829,166,523 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	347,670,352 円	369,686,908 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	450,669,996 円	485,813,963 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	697,495,659 円	772,789,435 円
グローバルREITファンド 2021-07(適格機関投資家専用)	832,945,758 円	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)	203,476,731 円	207,708,483 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)	18,783,696 円	17,339,520 円

区分	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	24,992,939 円	26,018,161 円
計	25,508,106,430 円	24,494,736,083 円
2. 期末日における受益権の総数	25,508,106,430 口	24,494,736,083 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 2023年3月7日 至 2023年9月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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9月6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

区分	2023年9月6日現在
	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	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△875,711,788	△820,399,019
合計	△875,711,788	△820,399,019

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

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

#### 通貨関連

種類	2023年3月6日現在				2023年9月6日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	50,613,406	-	50,606,331	7,075	195,314,381	-	195,288,275	26,106
アメリカ・ドル	50,613,406	-	50,606,331	7,075	57,690,564	-	57,681,317	9,247
シンガポール・ドル	-	-	-	-	137,623,817	-	137,606,958	16,859
買建	50,613,406	-	50,651,032	37,626	195,314,381	-	195,281,109	△33,272
アメリカ・ドル	-	-	-	-	137,623,817	-	137,640,803	16,986
シンガポール・ドル	22,141,412	-	22,189,731	48,319	-	-	-	-
ユーロ	28,471,994	-	28,461,301	△10,693	57,690,564	-	57,640,306	△50,258
合計	101,226,812	-	101,257,363	44,701	390,628,762	-	390,569,384	△7,166

(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3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額	3,6158円	3,7754円
(1万口当たり純資産額)	(36,158円)	(37,754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	SIMON PROPERTY GROUP INC	213,319	24,518,885.860		
		EQUINIX INC	20,417	15,691,689.520		
		AMERICAN TOWER CORP	50,689	9,145,309.380		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	345,569	5,494,547.100		
		KIMCO REALTY CORP	517,958	9,597,761.740		
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	549,697	9,394,321.730		
		INVITATION HOMES INC	668,615	22,645,990.050		
		AMERICOLD REALTY TRUST	346,534	11,387,107.240		
		VICI PROPERTIES INC	194,963	6,008,759.660		
		APARTMENT INCOME REIT CO	137,832	4,591,183.920		
		DIGITAL CORE REIT UNITS	13,162,156	7,634,050.480		
		IRON MOUNTAIN INC	37,196	2,353,762.880		
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	136,923	5,130,504.810		
		SUN COMMUNITIES INC	94,871	11,462,314.220		
		PROLOGIS INC	238,359	29,091,715.950		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	103,022	10,845,125.940		
		COUSINS PROPERTIES INC	131,762	3,076,642.700		
		SITE CENTERS CORP	126,095	1,661,932.100		
		EASTGROUP PROPERTIES INC	7,692	1,343,484.720		
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	94,339	4,808,458.830		
		WELLTOWER INC	308,171	24,918,707.060		
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	101,201	2,426,799.980		
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	101,060	14,342,435.200		
		REALTY INCOME CORP	365,942	20,218,295.500		
		PUBLIC STORAGE	16,637	4,511,788.030		
		UDR INC	222,825	8,783,761.500		
		WP CAREY INC	20,833	1,328,103.750		
	AGREE REALTY CORP	44,816	2,697,026.880			
	DIGITAL REALTY TRUST INC	180,400	23,578,280.000			
	EXTRA SPACE STORAGE INC	97,113	12,401,330.100			
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	381,476	2,719,923.880			
		アメリカ・ドル 小計			313,810,000.710 (46,399,946,705)	
	イギリス・ポンド		LXI REIT PLC	4,804,276	4,369,489.020	
URBAN LOGISTICS REIT PLC			888,246	1,014,376.930		
LAND SECURITIES GROUP PLC			1,337,539	7,690,849.250		
SEGRO PLC			1,294,929	9,258,742.350		
UNITE GROUP PLC/THE			850,181	7,770,654.340		

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		BRITISH LAND CO PLC	600,833	1,873,397.290	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	299,090	1,234,643.520	
		WORKSPACE GROUP PLC	365,658	1,774,172.610	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	522,114	4,464,074.700	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	4,504,771	6,198,564.890	
		イギリス・ポンド 小計		45,648,964.900 (8,474,730,333)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	1,734,684	13,409,107.320	
		HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	4,832,717	7,490,711.350	
		NATIONAL STORAGE REIT	5,141,919	11,774,994.510	
		MIRVAC GROUP	5,665,792	13,711,216.640	
		STOCKLAND	4,398,084	18,340,010.280	
		GOODMAN GROUP	2,391,460	55,242,726.000	
		CHARTER HALL GROUP	1,680,022	17,757,832.540	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,668,535	15,297,790.950	
		オーストラリア・ドル 小計		153,024,389.590 (14,401,125,305)	
	カナダ・ドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	301,489	4,190,697.100	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	133,443	6,564,061.170	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	836,030	16,177,180.500	
		カナダ・ドル 小計		26,931,938.770 (2,918,075,565)	
	シンガポール・ドル	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	4,336,300	5,116,834.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	8,042,900	15,361,939.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	4,673,100	7,850,808.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	5,594,100	12,586,725.000	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,134,677	19,357,732.290	
		シンガポール・ドル 小計		60,274,038.290 (6,543,952,336)	
	ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,707,350	10,309,096.500	
		ニュージーランド・ドル 小計		10,309,096.500 (895,035,758)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	201,090	4,484,307.000	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	152,911	7,489,580.780	
		GECINA SA	23,737	2,315,544.350	
		KLEPIERRE	342,991	8,296,952.290	
		COVIVIO	61,043	2,676,125.120	
		MERCIALYS	258,345	2,285,061.520	
		AEDIFICA	47,864	2,857,480.800	
		COFINIMMO	97,433	6,766,721.850	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	312,331	7,820,768.240	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	877,814	7,119,071.540	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	ユーロ 小計			52,111,613.490 (8,257,606,274)	
	香港・ドル	LINK REIT	3,658,692	142,323,118.800	
	香港・ドル 小計			142,323,118.800 (2,682,790,789)	
投資証券 合計				90,573,263,065 [90,573,263,065]	
合計				90,573,263,065 [90,573,263,065]	

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 31 銘柄	100%	51.2%
イギリス・ポンド	投資証券 10 銘柄	100%	9.4%
オーストラリア・ドル	投資証券 8 銘柄	100%	15.9%
カナダ・ドル	投資証券 3 銘柄	100%	3.2%
シンガポール・ドル	投資証券 5 銘柄	100%	7.2%
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%	9.1%
香港・ドル	投資証券 1 銘柄	100%	3.0%

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  
「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

	2023年3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,031,955,494	3,785,456,340
投資証券 ※2	133,984,145,700	163,340,693,700
派生商品評価勘定	1,763,310	26,281,440
未収入金	174,774,993	526,745,063
未収配当金	2,048,407,064	2,296,129,171
前払金	58,228,200	-
流動資産合計	137,299,274,761	169,975,305,714
資産合計	137,299,274,761	169,975,305,714
負債の部		
流動負債		
前受金	-	38,251,000
未払金	562,763,777	628,856,366
未払解約金	167,000	5,763,000
流動負債合計	562,930,777	672,870,366
負債合計	562,930,777	672,870,366
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	41,048,417,431	47,289,559,867
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	95,687,926,553	122,012,875,481
元本等合計	136,736,343,984	169,302,435,348
純資産合計	136,736,343,984	169,302,435,348
負債純資産合計	137,299,274,761	169,975,305,714

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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	40,916,300,869 円	41,048,417,431 円
期中追加設定元本額	2,322,121,272 円	6,323,321,872 円
期中一部解約元本額	2,190,004,710 円	82,179,436 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)	38,025,291,086 円	44,146,208,889 円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	11,182,476 円	11,179,771 円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	8,637,531 円	8,632,593 円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	41,696,345 円	42,948,356 円
6 資産バランスファンド (分配型)	74,974,898 円	75,286,260 円
6 資産バランスファンド (成長型)	216,194,831 円	217,513,108 円
世界 6 資産均等分散ファンド (毎月分配型)	21,134,370 円	20,845,419 円

区分	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	24,787,424 円	24,511,553 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	372,073,011 円	392,423,335 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	484,322,003 円	514,795,008 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	750,395,010 円	818,127,151 円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	248,773,150 円	239,595,173 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）	54,774,030 円	55,354,600 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）	18,604,861 円	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	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）	604,588,372 円	612,829,430 円
計	41,048,417,431 円	47,289,559,867 円
2. 期末日における受益権の総数	41,048,417,431 口	47,289,559,867 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 964,400,000 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 1,052,900,000 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 2023年3月7日 至 2023年9月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

区分	自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
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 9 月 6 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	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資証券	△8,341,247,545	3,363,812,446
合計	△8,341,247,545	3,363,812,446

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 不動産投信関連

種類	2023 年 3 月 6 日現在				2023 年 9 月 6 日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	2,019,267,200	-	2,021,152,500	1,885,300	3,388,175,000	-	3,414,654,000	26,479,000

種類	2023年3月6日現在				2023年9月6日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
合計	2,019,267,200	-	2,021,152,500	1,885,300	3,388,175,000	-	3,414,654,000	26,479,000

(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3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額	3.3311円	3.5801円
(1万口当たり純資産額)	(33,311円)	(35,801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	サンケイリアルエステート	6,980	661,704,000	
	SOSILA 物流リート投	5,548	719,020,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	10,000	6,510,000,000	
	森ヒルズリート	17,797	2,642,854,500	
	産業ファンド	18,934	2,785,191,400	
	アドバンス・レジデンス	14,816	5,118,928,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	24,823	5,696,878,500	
	A P I 投資法人	5,832	2,423,196,000	
	G L P 投資法人	76,095	10,561,986,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,307	3,810,459,000	
	日本プロロジスリート	37,736	11,154,761,600	
	星野リゾート・リート	1,585	1,028,665,000	
	O n e リート投資法人	6,563	1,717,537,100	
	イオンリート投資	27,569	4,096,753,400	
	ヒューリックリート投資法	15,878	2,594,465,200	
	日本リート投資法人	8,993	3,214,997,500	
	積水ハウス・リート投資	28,027	2,351,465,300	
	トーセイ・リート投資法人	1,238	173,939,000	
	ケネディクス商業リート	15,925	4,651,692,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	4,242	635,451,600	
	野村不動産マスターF	38,361	6,621,108,600	
	ラサールロジポート投資	29,755	4,433,495,000	
	スターアジア不動産投	7,455	429,408,000	
	三井不ロジパーク	3,185	1,598,870,000	
	三菱地所物流 REIT	12,983	5,108,810,500	
	CRE ロジスティクスファンド	6,298	1,081,996,400	
	ザイマックス・リート	5,656	663,448,800	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,552	599,498,400	
	日本ビルファンド	22,761	14,271,147,000	※
	ジャパンリアルエステイト	7,759	4,764,026,000	※
	日本都市ファンド投資法人	86,083	8,608,300,000	
	オリックス不動産投資	25,421	4,718,137,600	
	日本プライムリアルティ	15,953	5,966,422,000	
NTT 都市開発リート投資法人	14,405	2,013,819,000		
東急リアル・エステート	2,291	433,915,400		
ユナイテッド・アーバン投資法人	32,820	5,251,200,000		
インヴィンシブル投資法人	44,869	2,858,155,300		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	フロンティア不動産投資	5,024	2,388,912,000	
	平和不動産リート	4,268	629,103,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,943	594,558,000	
	福岡リート投資法人	857	141,405,000	
	いちごオフィスリート投資法人	11,006	989,439,400	
	大和証券オフィス投資法人	2,990	2,072,070,000	
	阪急阪神リート投資法人	7,799	1,129,295,200	
	スターツプロシード投資法人	1,109	244,534,500	
	大和ハウスリート投資法人	28,800	7,629,120,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	73,188	5,415,912,000	
	大和証券リビング投資法人	1,200	134,640,000	
投資証券 合計			163,340,693,700	
合計			163,340,693,700	

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。

「ダイワ日本ハーモニースtock・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3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,396,148	17,834,670
株式	1,234,780,100	1,361,874,150
未収配当金	331,500	348,000
流動資産合計	1,264,507,748	1,380,056,820
資産合計	1,264,507,748	1,380,056,820
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	789,664,444	693,363,198
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	474,843,304	686,693,622
元本等合計	1,264,507,748	1,380,056,820
純資産合計	1,264,507,748	1,380,056,820
負債純資産合計	1,264,507,748	1,380,056,820



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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	843,798,678 円	789,664,444 円
期中追加設定元本額	20,501,346 円	- 円
期中一部解約元本額	74,635,580 円	96,301,246 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6 資産バランスファンド（分配型）	163,652,043 円	144,174,558 円
6 資産バランスファンド（成長型）	579,532,981 円	509,453,834 円
世界 6 資産均等分散ファンド（毎月分配型）	46,479,420 円	39,734,806 円
計	789,664,444 円	693,363,198 円
2. 期末日における受益権の総数	789,664,444 口	693,363,198 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 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 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。

区分	自 2023 年 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 6 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	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 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	53,987,800	240,513,496
合計	53,987,800	240,513,496

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 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)

	2023 年 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6013 円 (16,013 円)	1.9904 円 (19,904 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	
大和ハウス	7,500	4,097.00	30,727,500	
味の素	8,400	6,100.00	51,240,000	
GMOペイメントゲートウェイ	900	9,545.00	8,590,500	
日産化学	2,900	6,302.00	18,275,800	
イビデン	3,700	9,264.00	34,276,800	
信越化学	9,000	4,764.00	42,876,000	
野村総合研究所	7,500	4,286.00	32,145,000	
テルモ	5,200	4,374.00	22,744,800	
第一三共	9,700	4,221.00	40,943,700	
オリエンタルランド	8,100	5,287.00	42,824,700	
富士フイルムHLDGS	2,600	8,825.00	22,945,000	
住友電工	19,400	1,840.00	35,696,000	
リクルートホールディングス	10,500	5,339.00	56,059,500	
ディスコ	1,800	28,680.00	51,624,000	
SMC	100	72,760.00	7,276,000	
ダイキン工業	1,600	26,125.00	41,800,000	
日立	7,500	10,140.00	76,050,000	
ソニーグループ	5,600	12,690.00	71,064,000	
キーエンス	500	60,720.00	30,360,000	
デンソー	5,700	10,335.00	58,909,500	
村田製作所	3,700	8,540.00	31,598,000	
トヨタ自動車	44,900	2,651.00	119,029,900	
HOYA	1,100	16,630.00	18,293,000	
バンダイナムコHLDGS	4,800	3,383.00	16,238,400	
アシックス	10,200	5,369.00	54,763,800	
任天堂	9,400	6,323.00	59,436,200	
東京エレクトロン	2,800	22,115.00	61,922,000	
ユニ・チャーム	4,100	5,756.00	23,599,600	
三菱UFJフィナンシャルG	44,800	1,230.00	55,104,000	
三井住友フィナンシャルG	6,200	7,002.00	43,412,400	
東京海上HD	7,900	3,340.00	26,386,000	
三井不動産	5,500	3,410.00	18,755,000	
日本電信電話	215,500	169.10	36,441,050	
ファーストリテイリング	600	34,110.00	20,466,000	
合計			1,361,874,150	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「ダイワ外国ハーモニースtock・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3月6日現在 金額(円)	2023年9月6日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,706,365	-
コール・ローン	218,948	755,246
株式	1,246,726,002	1,343,316,948
未収入金	9,904,108	68,008,953
未収配当金	1,590,179	1,589,601
流動資産合計	1,263,145,602	1,413,670,748
資産合計	1,263,145,602	1,413,670,748
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	4,292
前受金	-	64,288,899
未払金	8,297,321	-
流動負債合計	8,297,321	64,293,191
負債合計	8,297,321	64,293,191
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	328,472,263	292,224,192
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	926,376,018	1,057,153,365
元本等合計	1,254,848,281	1,349,377,557
純資産合計	1,254,848,281	1,349,377,557
負債純資産合計	1,263,145,602	1,413,670,748

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 3 月 7 日 至 2023 年 9 月 6 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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 3 月 6 日現在	2023 年 9 月 6 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 7 日	2023 年 3 月 7 日
期首元本額	340,205,998 円	328,472,263 円
期中追加設定元本額	9,523,484 円	278,575 円
期中一部解約元本額	21,257,219 円	36,526,646 円

区分	2023年3月6日現在	2023年9月6日現在
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6資産バランスファンド（分配型）	68,176,150円	61,603,428円
6資産バランスファンド（成長型）	241,368,049円	214,072,686円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	18,928,064円	16,548,078円
計	328,472,263円	292,224,192円
2. 期末日における受益権の総数	328,472,263口	292,224,192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2023年3月7日 至2023年9月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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9月6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。

区分	2023年9月6日現在
	(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	2023年3月6日現在	2023年9月6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	68,410,346	165,063,498
合計	68,410,346	165,063,498

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年3月6日現在				2023年9月6日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	-	-	-	-	3,000,000	-	3,004,292	△4,292
アメリカ・ドル	-	-	-	-	3,000,000	-	3,004,292	△4,292
合計	-	-	-	-	3,000,000	-	3,004,292	△4,292

(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3月6日現在	2023年9月6日現在
1口当たり純資産額	3,8203円	4,6176円
(1万口当たり純資産額)	(38,203円)	(46,176円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	ABBOTT LABORATORIES	255	100.880	25,724.400	
	ADOBE INC	145	564.880	81,907.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	100	292.700	29,270.000	
	DR HORTON INC	450	114.280	51,426.000	
	MOODY'S CORP	40	338.300	13,532.000	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	75	252.850	18,963.750	
	HESS CORP	130	157.830	20,517.900	
	DANAHER CORP	125	260.850	32,606.250	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	150	114.640	17,196.000	
	APPLE INC	3,190	189.700	605,143.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	285	34.300	9,775.500	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	325	360.470	117,152.750	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140	60.640	8,489.600	
	JPMORGAN CHASE & CO	910	145.200	132,132.000	
	CADENCE DESIGN SYS INC	325	245.510	79,790.750	
	SERVICENOW INC	145	597.160	86,588.200	
	CATERPILLAR INC	50	281.630	14,081.500	
	CISCO SYSTEMS INC	810	57.260	46,380.600	
	MORGAN STANLEY	745	84.840	63,205.800	
	MSCI INC	55	541.160	29,763.800	
	BROADCOM INC	140	872.170	122,103.800	
	DEERE & CO	150	414.430	62,164.500	
	QUANTA SERVICES INC	350	208.810	73,083.500	
	AECOM	525	86.720	45,528.000	
	AMETEK INC	400	157.120	62,848.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	145	544.730	78,985.850	
	HCA HEALTHCARE INC	200	274.250	54,850.000	
	T-MOBILE US INC	265	136.890	36,275.850	
	COCA-COLA CO/THE	1,125	58.820	66,172.500	
	AMAZON.COM INC	2,300	137.270	315,721.000	
	EXXON MOBIL CORP	1,500	113.530	170,295.000	
	NEXTERA ENERGY INC	375	66.200	24,825.000	
	UNITED RENTALS INC	25	470.620	11,765.500	
	FISERV INC	285	121.810	34,715.850	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	130	323.750	42,087.500	
	ALPHABET INC-CL C	2,500	136.710	341,775.000	
	HOME DEPOT INC	250	327.780	81,945.000	
	HUMANA INC	10	470.220	4,702.200	
	HUBBELL INC	125	313.740	39,217.500	
	ZOETIS INC	225	190.430	42,846.750	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	300	200.540	60,162.000		
JOHNSON & JOHNSON	435	160.680	69,895.800		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ABBVIE INC	295	146.100	43,099.500	
	KLA CORP	155	512.550	79,445.250	
	LOWE'S COS INC	350	230.430	80,650.500	
	ELI LILLY & CO	300	558.190	167,457.000	
	LAM RESEARCH CORP	75	700.770	52,557.750	
	MCDONALD'S CORP	225	279.160	62,811.000	
	META PLATFORMS INC CLASS A	500	300.150	150,075.000	
	S&P GLOBAL INC	130	393.550	51,161.500	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	700	43.220	30,254.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	400	57.890	23,156.000	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	175	307.200	53,760.000	
	MERCK & CO. INC.	700	107.510	75,257.000	
	MARSH & MCLENNAN COS	250	192.960	48,240.000	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	270	201.030	54,278.100	
	NIKE INC -CL B	475	100.320	47,652.000	
	KKR & CO INC	900	61.980	55,782.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	45	945.530	42,548.850	
	PFIZER INC	275	35.380	9,729.500	
	CIGNA CORP	50	278.750	13,937.500	
	STRYKER CORP	225	286.290	64,415.250	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	695	152.440	105,945.800	
	CONOCOPHILLIPS	630	122.830	77,382.900	
	PEPSICO INC	400	174.160	69,664.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	75	326.160	24,462.000	
	QUALCOMM INC	100	116.550	11,655.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	20	822.910	16,458.200	
	REPUBLIC SERVICES INC	75	145.070	10,880.250	
	BOOKING HOLDINGS INC	21	3,144.640	66,037.440	
	ROSS STORES INC	100	120.610	12,061.000	
	CHEVRON CORP	305	166.460	50,770.300	
	TESLA INC	660	256.490	169,283.400	
	SYNOPSIS INC	175	466.850	81,698.750	
	AT&T INC	200	14.480	2,896.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	100	169.740	16,974.000	
	SALESFORCE.COM INC	600	218.690	131,214.000	
	UNION PACIFIC CORP	15	215.710	3,235.650	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	158	480.810	75,967.980	
	ELEVANCE HEALTH INC	15	450.150	6,752.250	
	WALT DISNEY CO/THE	195	81.190	15,832.050	
	WELLS FARGO & CO	645	41.540	26,793.300	
	WASTE MANAGEMENT INC	35	157.030	5,496.050	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	125	218.080	27,260.000	
	TJX COMPANIES INC	900	91.620	82,458.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	550	245.340	134,937.000	
	NVIDIA CORP	730	485.480	354,400.400	
	NETFLIX INC	100	448.680	44,868.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	130	542.010	70,461.300	
	ORACLE CORP	750	123.980	92,985.000	
	MASTERCARD INC - A	330	411.500	135,795.000	
	YUM! BRANDS INC	270	128.680	34,743.600	
	BANK OF AMERICA CORP	1,350	28.650	38,677.500	
	AMERICAN EXPRESS CO	385	160.000	61,600.000	
	LINDE PLC	150	381.600	57,240.000	
	ANALOG DEVICES INC	225	181.540	40,846.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	350	110.780	38,773.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	550	97.880	53,834.000	
	AON PLC-CLASS A	100	329.450	32,945.000	
	AMGEN INC	50	254.010	12,700.500	
	EATON CORP PLC	400	229.570	91,828.000	
	APPLIED MATERIALS INC	550	153.610	84,485.500	
	CME GROUP INC	25	202.530	5,063.250	
	GILEAD SCIENCES INC	100	75.160	7,516.000	
	INTEL CORP	700	36.710	25,697.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	25	307.680	7,692.000	
	WW GRAINGER INC	40	693.010	27,720.400	
	CINTAS CORP	105	496.740	52,157.700	
	MICROSOFT CORP	1,555	333.550	518,670.250	
	MICRON TECHNOLOGY INC	600	70.290	42,174.000	
	BLACKROCK INC	65	695.930	45,235.450	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	840	69.560	58,430.400	
	CHUBB LTD	200	200.060	40,012.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	45	161.070	7,248.150	
	PROGRESSIVE CORP	50	133.520	6,676.000	
	STARBUCKS CORP	200	96.840	19,368.000	
	INTUIT INC	105	550.580	57,810.900	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,300	53.300	69,290.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	170	348.260	59,204.200	
	COMCAST CORP-CLASS A	900	44.560	40,104.000	
アメリカ・ドル	小計			8,094,249.520 (1,196,815,734)	
イギリス・ポンド	BHP GROUP PLC	1,775	23.360	41,464.000	
	BP PLC	3,600	5.115	18,414.000	
	DIAGEO PLC	150	31.475	4,721.250	
	SSE PLC	200	15.820	3,164.000	
	ASTRAZENECA PLC	575	107.360	61,732.000	
イギリス・ポンド	小計			129,495.250 (24,040,793)	
スイス・フラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30	253.900	7,617.000	
	ABB LTD-REG	1,700	33.020	56,134.000	
	NESTLE SA-REG	465	103.740	48,239.100	
	NOVARTIS AG-REG	285	87.790	25,020.150	
スイス・フラン	小計			137,010.250	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
				(22,764,253)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	650	1,323.600	860,340.000	
デンマーク・クローネ 小計				860,340.000 (18,290,828)	
ユーロ	SIEMENS AG-REG	350	137.960	48,286.000	
	RWE AG	100	36.560	3,656.000	
	SAP SE	25	128.260	3,206.500	
	AIXTRON SE	1,500	36.510	54,765.000	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,335	32.850	43,854.750	
	ASML HOLDING NV	150	619.400	92,910.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	360	156.720	56,419.200	
	L'OREAL	90	403.850	36,346.500	
	PERNOD RICARD SA	145	179.100	25,969.500	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	100	759.100	75,910.000	
	STMICROELECTRONICS NV	500	43.470	21,735.000	
IBERDROLA SA	2,900	10.640	30,856.000		
ユーロ 小計				493,914.450 (78,265,684)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	2,400	69.400	166,560.000	
香港・ドル 小計				166,560.000 (3,139,656)	
合計				1,343,316,948 [1,343,316,948]	

(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
アメリカ・ドル	株式 120 銘柄	100%	89.1%
イギリス・ポンド	株式 5 銘柄	100%	1.8%
スイス・フラン	株式 4 銘柄	100%	1.7%
デンマーク・クローネ	株式 1 銘柄	100%	1.4%
ユーロ	株式 12 銘柄	100%	5.8%
香港・ドル	株式 1 銘柄	100%	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2023年9月29日

I 資産総額	436,674,513 円
II 負債総額	404,430 円
III 純資産総額 (I - II)	436,270,083 円
IV 発行済数量	408,158,331 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.0689 円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

### 純資産額計算書

2023年9月29日

I 資産総額	16,418,724,709 円
II 負債総額	7,945,562 円
III 純資産総額 (I - II)	16,410,779,147 円
IV 発行済数量	8,526,397,070 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.9247 円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

### 純資産額計算書

2023年9月29日

I 資産総額	98,620,159,122 円
II 負債総額	49,045,847 円
III 純資産総額 (I - II)	98,571,113,275 円
IV 発行済数量	80,725,426,223 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.2211 円

(参考) ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

純資産額計算書

2023年9月29日

I 資産総額	1,311,122,695 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	1,311,122,695 円
IV 発行済数量	294,214,094 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	4.4564 円

(参考) ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

純資産額計算書

2023年9月29日

I 資産総額	1,317,331,508 円
II 負債総額	0 円
III 純資産総額 (I - II)	1,317,331,508 円
IV 発行済数量	687,260,922 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.9168 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9月29日

I 資産総額	87,502,809,735 円
II 負債総額	275,958,922 円
III 純資産総額 (I - II)	87,226,850,813 円
IV 発行済数量	24,317,239,371 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.5870 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9月29日

I 資産総額	169,220,931,821 円
II 負債総額	1,064,075,881 円
III 純資産総額 (I - II)	168,156,855,940 円
IV 発行済数量	48,193,302,487 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.4892 円



#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典  
ありません。
- (3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
- (4) 受益証券の再発行  
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の譲渡
  - ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
  - ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
  - ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (8) 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。
- (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2023年9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9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	88	291,527
追加型株式投資信託	772	24,149,619
株式投資信託 合計	860	24,441,146
単位型公社債投資信託	102	172,656
追加型公社債投資信託	14	1,534,905
公社債投資信託 合計	116	1,707,562
総合計	976	26,148,708

### 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	※1
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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

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

## 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

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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	15,348	未払手数料	3,028
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱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 通常の見積り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

(世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型))

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22条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
6. ダイワJ-REITアクティブ・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、株式、および不動産投資信託証券に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- 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。  
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の6分の1  
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券……………信託財産の純資産総額の6分の1  
ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の6分の1  
ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の6分の1  
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6分の1  
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6分の1
- 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。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。
- ④ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### (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と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。なお、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。
- 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  
(世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型))  
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500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、2,000億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43条第1項、第44条第1項、第45条第1項および第47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500億円を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。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24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。ただし、保護預りではない受益証券にかかる受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。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（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）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（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）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 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の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ③ 第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④ 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34条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に関する振替の申請をするものとし、

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、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、

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

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

第15条 (削 除)

第16条 (削 除)

第17条 (削 除)

第18条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第19条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとし、

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第20条 委託者は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の第1号から第6号までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の第7号から第10号までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券

3. ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券

4. ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券

5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券

6. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券

7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

8. 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

9. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第21条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第25条において同じ。）、第25条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第19条および第20条に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

② 前項の取扱いは、第24条、第29条から第31条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

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

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第23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24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24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25条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

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

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

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

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

第26条 (削 除)

(混蔵寄託)

第27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28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29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30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31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32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33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34条 この信託の計算期間は、毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年6月28日から2006年7月6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35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36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、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37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34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131の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ④ 委託者は、この信託において主要投資対象とするダイワ・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。

(収益の分配方式)

第38条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。ただし、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

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

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第39条 収益分配金は、第1、第2および第3計算期間を除く毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、2007年1月4日以降においても、第41条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、2007年1月4日以降においても、第41条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

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

第40条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

（収益分配金および償還金の時効）

第41条 受益者が、収益分配金については第39条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第39条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第42条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に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、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、2007年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第42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43条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託

契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- 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44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48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45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48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46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47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48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48条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第49条 第43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43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49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50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51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39条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

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

2006年 6月28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