

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2026年10月6日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 佐野 径
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	川根 浩志 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて、5,000億円を上限とし、合計で1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

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

(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】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2026年10月7日から2027年4月5日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

商品分類表〈各ファンド共通〉

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国 内	株 式
	海 外	債 券
追加型投信	内 外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	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 分固定型	資産配	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 分変更型	資産配	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回		目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

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

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（アドレス<https://www.imaj.or.jp/>）をご参照下さい。

※ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

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

<信託金の限度額>

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

<ファンドの目的・特色>

ファンドの目的

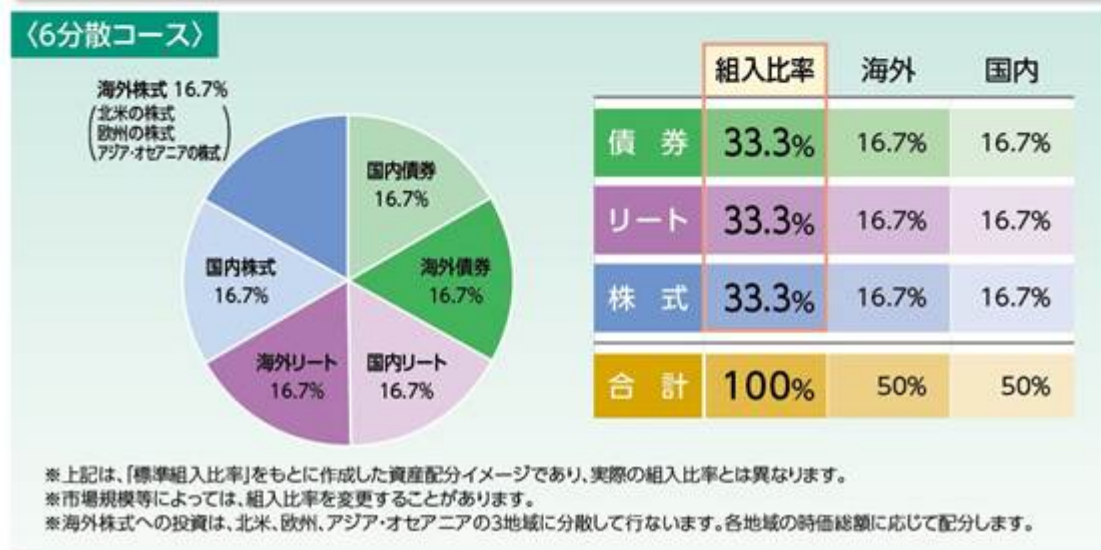
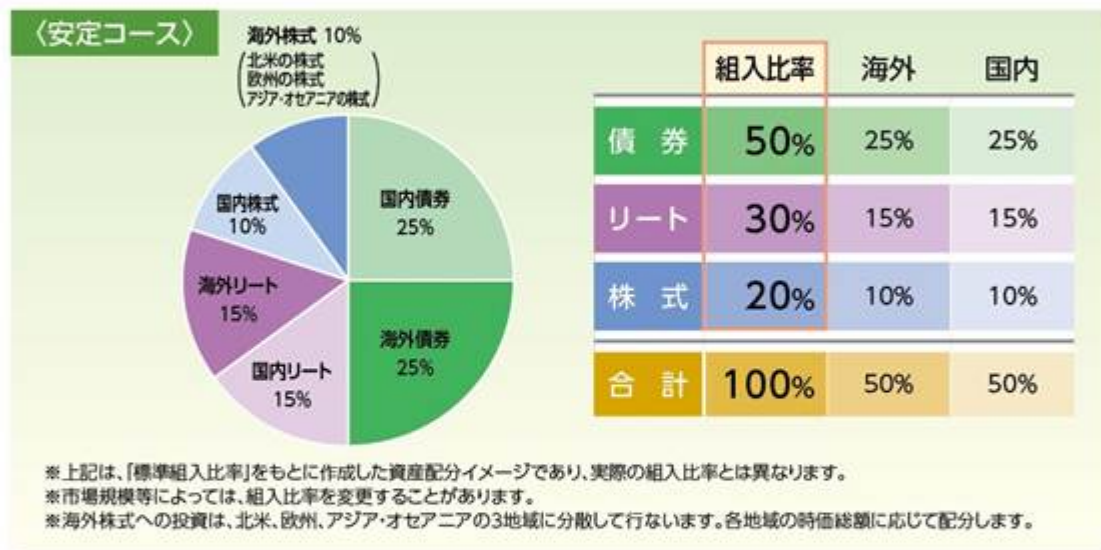
内外の債券、リート（不動産投資信託）および株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

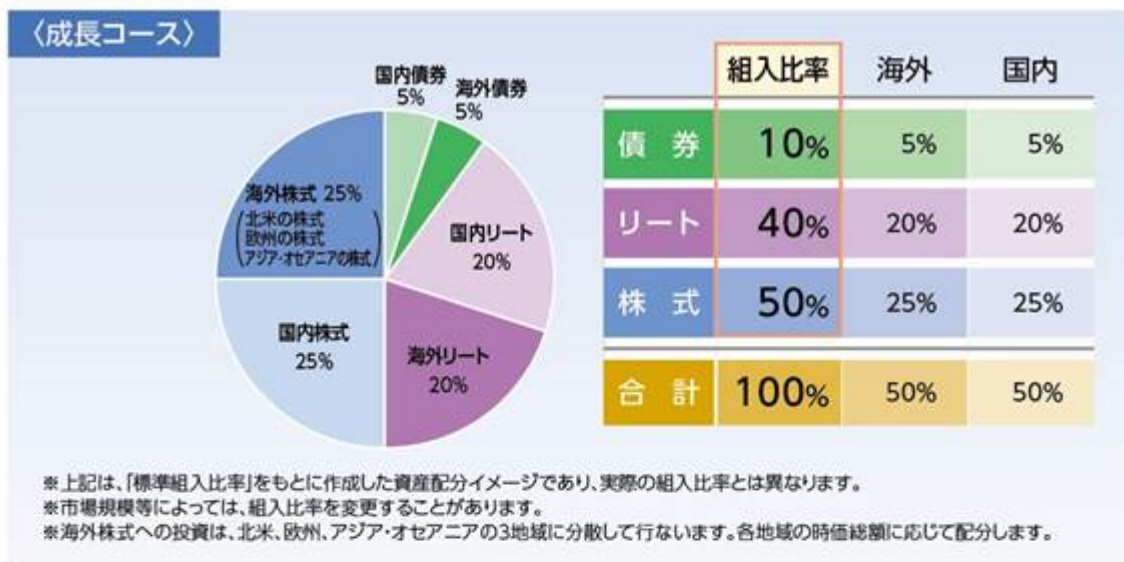
ファンドの特色

1

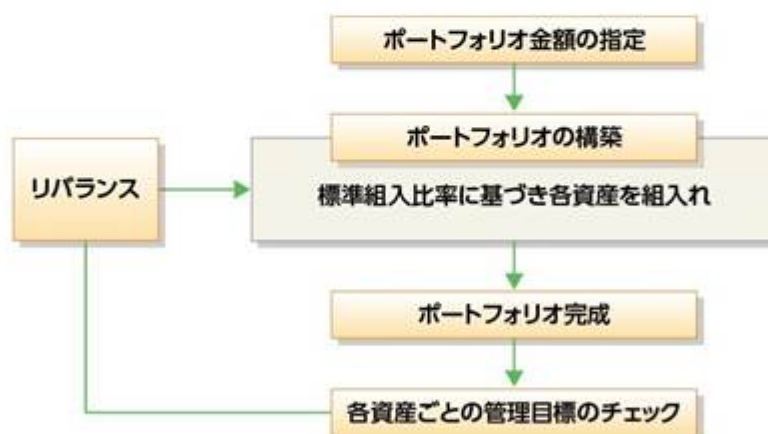
内外の債券、リートおよび株式に投資します。

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





運用プロセス



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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

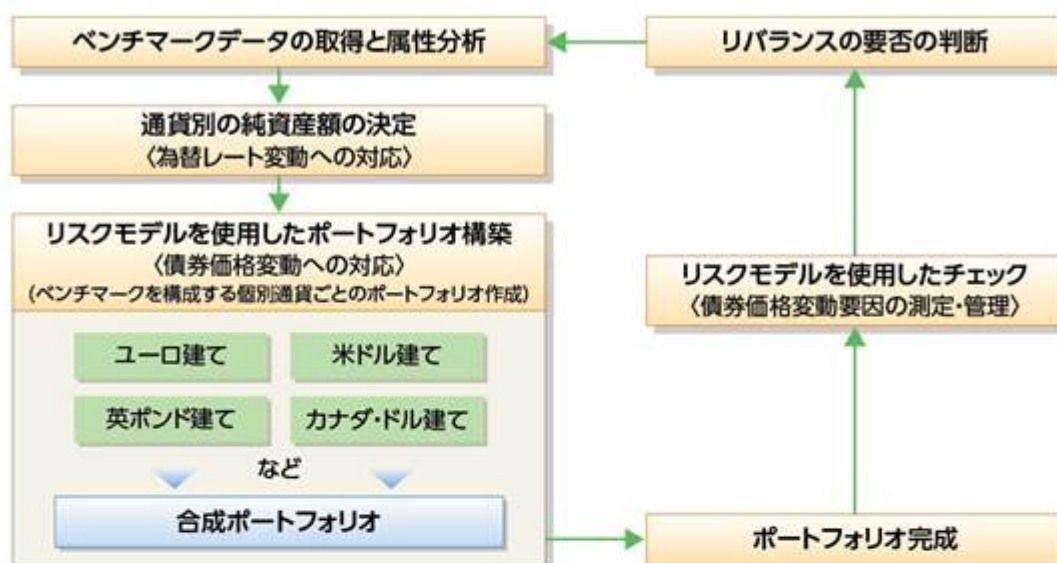
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



2

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

運用プロセス



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

① 為替レート変動への対応

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

② 債券価格変動への対応

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

③ 債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

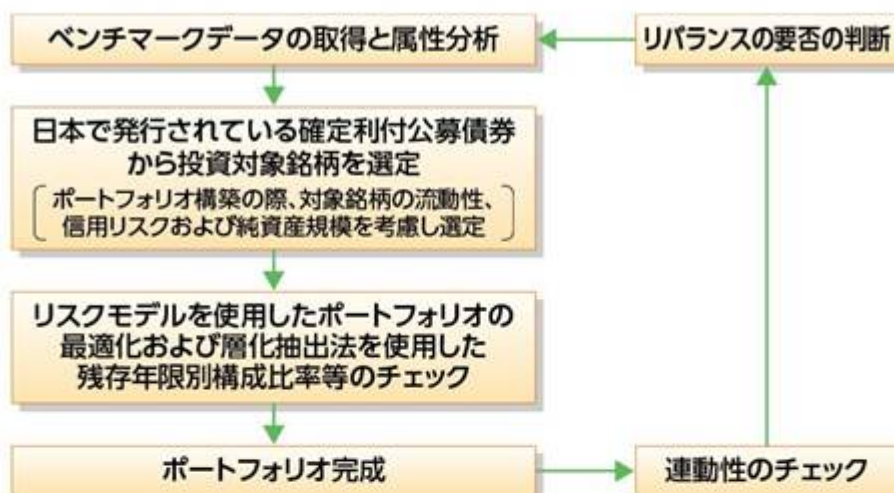
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE世界国債インデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

3

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

運用プロセス



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

(注1)リスクモデルとは…

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

(注2)層化抽出法とは…

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは

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

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

4

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

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

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

投資対象銘柄の業種

(イメージ)



投資対象地域

(イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて

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

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

投資対象銘柄の業種

(イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

5

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

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散投資します。各地域の時価総額に応じて配分します。

投資対象のイメージ



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

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

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

※ハイブリッド優先証券とは…

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

- 欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

アムンディ・アイルランド・リミテッドについて

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

6

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

投資対象のイメージ



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

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

銘柄選定プロセス



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

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



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



毎年1月10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

●分配方針

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への直接投資は、行ないません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(2) 【ファンドの沿革】

2006年1月12日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）

お取扱窓口	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	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、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。 ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）

（注1）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

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

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

<委託会社の概況（2026年6月末日現在）>

・資本金の額 414億2,454万1,896円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日	株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携
2025年 7月 1日	大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

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

② 投資態度

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

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

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

(注) 3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

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

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

(2) 【投資対象】

<各ファンド共通>

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

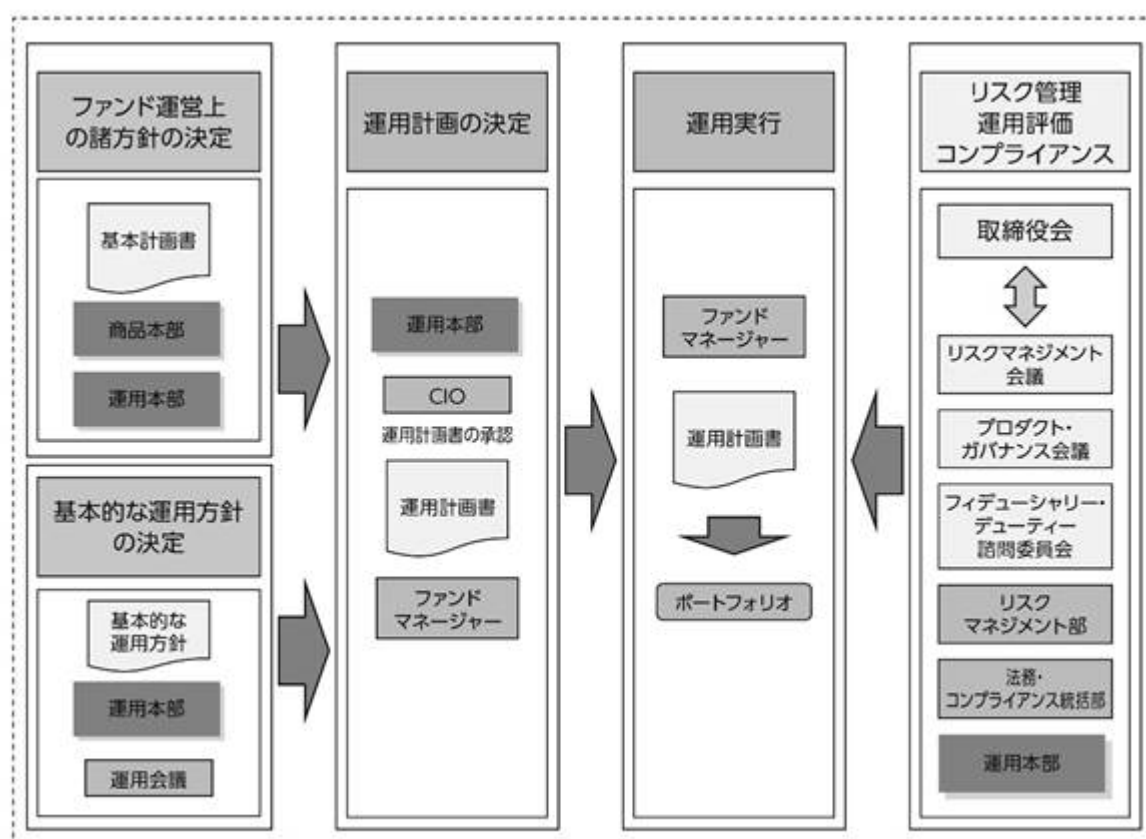
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2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本部長の決裁により決定します。

ロ. 基本的な運用方針の承認

運用担当チームは、基本的な運用方針を作成し、運用会議にて承認を受けます。

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承認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、CIOの承認を受けます。

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。

- ・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の承認
- ・運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する各信託財産等の運用計画書および変更運用計画書の承認
- ・その他信託財産等の運用に関する事項の決定

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）

運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する運用計画書および変更運用計画書を確認します。

ホ. 運用チームリーダー

次の職務を遂行します。

- ・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の立案
- ・運用計画書および変更運用計画書の作成または運用チームメンバーへの作成の指示
- ・運用計画に基づく運用プロセス等の実行および運用チームメンバーへの実行の指示

ヘ. ファンドマネージャー

次の職務を遂行します。

- ・運用チームリーダーの指示に基づく運用計画書および変更運用計画書の作成
- ・運用計画に基づく運用プロセス等の実行

④ リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびフィデューシャリー・デューティー諮問委員会

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

イ. リスクマネジメント会議

権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ. 運用の実行

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

ハ. モニタリング

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

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

ニ. （前④に同じ。）

※ 上記の運用体制は2026年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

＜各ファンド共通＞

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

＜各ファンド共通＞

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤ 信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑥ 資金の借入れ（信託約款）

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考>マザーファンドの概要

1. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新

株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式

- イ. 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、
- ロ. 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

② 同一銘柄の株式

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

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

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

⑤ スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 金利先渡し取引および為替先渡し取引

- 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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ。金利先渡し取引および為替先渡し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。金利先渡し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し取引の想定元本の合計額が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡し取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡し取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ。為替先渡し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し取引の想定元本の合計額が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡し取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡し取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ。金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

- イ。主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA－BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ。運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ。当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

- 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します。）

ハ、約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ、為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限りします。）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券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

① 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

ニ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態で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。

4. ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ. 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

（b）個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

ハ. 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態で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、(3) ⑤に定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

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

2. （ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

①～②（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

④ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 先物取引等

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

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

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

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ. （ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ. と同規定）

ニ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ. と同規定）

ホ. （ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ. と同規定）

(2) 投資対象

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書

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

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

- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

- ①（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
- ② 委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。
 - 1.～11.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するものなお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

<各ファンド共通>

- ① 株式
株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 先物取引等
イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建ておよびコール・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、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、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、

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、

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

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、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、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、

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、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、

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、

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

(4) 運用指図権限の委託

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

- ①（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）
- ②（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

- ① 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

- ②（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証書

2.～10. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12.～20. （ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

③ （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

③ 先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・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)③1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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)③1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・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、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

⑤ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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 ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

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

③ 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

④ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ、リー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、リーートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

ハ、リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リー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。

⑤ 外国証券への投資に伴うリスク

イ、為替リスク

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

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

ロ、カントリー・リスク

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

⑥ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

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

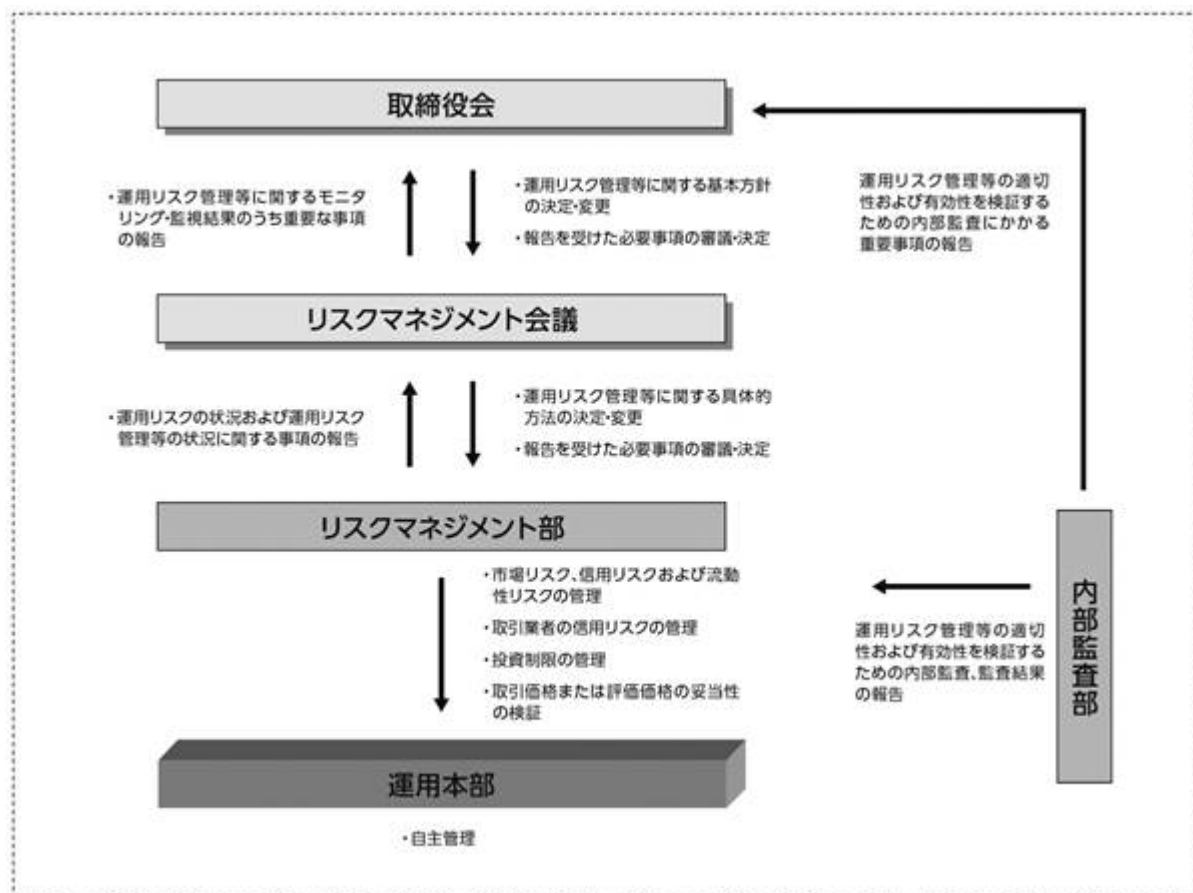
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

参考情報

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

右のグラフは過去5年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

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)



DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース)



DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽)成長コース



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

資産クラスの指数について

日本株 配当込みTOPIX	配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	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」)が発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。(https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html)
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	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。
先進国債 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	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。
新興国債 JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円ベース)	JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。 Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

	委託会社	販売会社	受託会社
安定コース	年率0.45% （税抜）	年率0.4% （税抜）	年率0.05% （税抜）
6分散コース	年率0.53% （税抜）	年率0.47% （税抜）	
成長コース	年率0.61% （税抜）	年率0.54% （税抜）	

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- ④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。
- ⑤ 委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

イ. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

ロ. ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15.315%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。

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、20.315%（所得税15.315%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。

ハ. 損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

＜注1＞個別元本について

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

＜注2＞収益分配金の課税について

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- ② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2026年6月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

(1)【投資状況】（2026年6月30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		13,628,115,409	99.12
	内 日本	13,628,115,409	99.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		121,193,582	0.88
純資産総額		13,749,308,991	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】（2026年6月30日現在）

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	805,797,924	4.1141 3,315,160,978	4.2359 3,413,279,426	24.83
2	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	3,057,248,226	1.1120 3,399,846,873	1.0888 3,328,731,868	24.21
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	360,571,051	5.2516 1,893,576,367	5.9069 2,129,857,141	15.49
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	501,867,234	4.3160 2,166,077,765	3.9543 1,984,533,603	14.43
5	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	141,183,684	8.6641 1,223,234,637	9.8116 1,385,237,833	10.07
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	121,813,379	8.5513 1,041,667,623	9.1202 1,110,962,379	8.08

7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	53,025,624	4.1400 219,529,385	4.4360 235,221,668	1.71
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,827,552	6.6079 25,292,135	10.5267 40,291,491	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715
第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
第15計算期間末 (2021年1月12日)	5,838,750,574	5,838,750,574	1.7702	1.7702

第16計算期間末 (2022年1月11日)	7,477,305,392	7,477,305,392	1.9976	1.9976
第17計算期間末 (2023年1月10日)	7,978,470,707	7,978,470,707	1.9057	1.9057
第18計算期間末 (2024年1月10日)	9,782,814,525	9,782,814,525	2.1309	2.1309
第19計算期間末 (2025年1月10日)	11,059,462,924	11,059,462,924	2.2652	2.2652
2025年6月末日	11,610,323,424	—	2.2888	—
7月末日	11,985,922,352	—	2.3418	—
8月末日	12,204,587,003	—	2.3701	—
9月末日	12,422,976,284	—	2.3971	—
10月末日	12,879,558,597	—	2.4633	—
11月末日	13,154,591,276	—	2.5070	—
12月末日	13,227,822,737	—	2.5098	—
第20計算期間末 (2026年1月13日)	13,293,631,388	13,293,631,388	2.5422	2.5422
2026年1月末日	13,113,444,628	—	2.5045	—
2月末日	13,620,500,717	—	2.5966	—
3月末日	13,104,383,875	—	2.4806	—
4月末日	13,561,248,964	—	2.5564	—
5月末日	13,612,510,622	—	2.5681	—
6月末日	13,749,308,991	—	2.6007	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第11計算期間	4.9
第12計算期間	5.4
第13計算期間	△4.2
第14計算期間	12.2
第15計算期間	0.4
第16計算期間	12.8
第17計算期間	△4.6
第18計算期間	11.8
第19計算期間	6.3
第20計算期間	12.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第11計算期間	389,459,803	224,474,896
第12計算期間	458,208,043	289,727,307
第13計算期間	575,990,631	232,603,369
第14計算期間	809,239,523	304,172,889
第15計算期間	963,521,848	459,114,213
第16計算期間	842,864,166	398,104,027
第17計算期間	810,744,400	367,320,010
第18計算期間	793,333,632	389,010,333
第19計算期間	841,548,697	550,162,879
第20計算期間	853,297,431	506,395,380

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		417,691,175,741	98.16
	内 ユーロ	120,384,952,029	28.29
	内 韓国	2,917,922,778	0.69
	内 中国	53,154,292,615	12.49
	内 シンガポール	1,372,168,735	0.32
	内 マレーシア	2,088,543,353	0.49
	内 イスラエル	1,711,290,041	0.40
	内 ノルウェー	644,857,151	0.15

内 スウェーデン	636,044,950	0.15
内 デンマーク	812,580,647	0.19
内 イギリス	23,532,107,949	5.53
内 ポーランド	2,998,385,630	0.70
内 カナダ	8,621,191,671	2.03
内 アメリカ	188,633,629,062	44.33
内 メキシコ	3,783,884,176	0.89
内 オーストラリア	5,330,535,037	1.25
内 ニュージーランド	1,068,789,917	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,828,516,761	1.84
純資産総額	425,519,692,502	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	3,336,164,895	0.78
内 日本	3,336,164,895	0.78
為替予約取引（売建）	104,532,240	△0.02
内 日本	104,532,240	△0.02

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 投資資産（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,700,000	100.19 1,903,616,338	99.05 1,882,065,348	3.500000 2028/01/31	0.44
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	98.56 1,840,667,915	97.79 1,826,288,280	2.875000 2028/05/15	0.43
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,800,000	104.82 1,838,385,980	102.15 1,791,659,262	4.625000 2035/02/15	0.42
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	99.61 1,698,462,180	97.10 1,655,664,295	3.875000 2034/08/15	0.39
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	102.07 1,690,698,152	99.53 1,648,708,969	4.125000 2032/11/15	0.39

6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	104.38 1,695,156,732	101.48 1,647,998,676	4.500000 2033/11/15	0.39
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	98.31 1,644,420,457	98.15 1,641,773,942	4.125000 2036/02/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	100.81 1,669,860,916	98.19 1,626,414,121	4.000000 2034/02/15	0.38
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.26 1,660,713,813	99.54 1,616,559,972	4.250000 2034/11/15	0.38
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,800,000	98.97 1,575,156,124	97.29 1,548,389,949	4.000000 2035/11/15	0.36
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	102.08 1,574,870,399	99.37 1,533,032,239	4.250000 2035/05/15	0.36
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	63,000,000	100.11 1,504,100,428	100.09 1,503,900,269	1.290000 2028/03/15	0.35
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	87.58 1,465,028,504	86.73 1,450,727,628	1.250000 2031/08/15	0.34
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.21 1,464,608,401	97.70 1,427,997,575	3.875000 2033/08/15	0.34
15	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.77 1,421,557,574	102.84 1,422,539,647	2.370000 2029/01/15	0.33
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	99.98 1,428,750,000	99.20 1,417,699,776	3.500000 2027/10/31	0.33
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	87.63 1,423,121,004	86.68 1,407,612,759	1.375000 2031/11/15	0.33
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.72 1,437,164,273	99.61 1,407,353,746	4.000000 2030/02/28	0.33
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.67 1,436,493,411	99.29 1,402,790,425	4.250000 2035/08/15	0.33
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	103.40 1,427,356,135	100.57 1,388,182,795	4.375000 2034/05/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	87.72 1,396,027,206	87.09 1,386,112,647	0.875000 2030/11/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.45 1,400,398,583	99.72 1,376,505,330	4.000000 2029/01/31	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	96.47 1,378,623,149	94.88 1,355,979,884	3.375000 2033/05/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	94.28 1,347,424,388	93.20 1,331,972,146	2.875000 2032/05/15	0.31
25	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	55,000,000	99.51 1,305,342,233	100.31 1,315,775,101	1.430000 2030/01/25	0.31

26	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	54,000,000	101.76 1,310,576,648	102.14 1,315,470,320	2.050000 2029/04/15	0.31
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.01 1,299,262,903	98.66 1,281,763,756	3.500000 2028/10/15	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.57 1,247,267,043	101.64 1,260,511,435	1.790000 2032/03/25	0.30
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	104.50 1,246,097,523	104.96 1,251,642,253	2.540000 2030/12/25	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.05 1,273,891,089	95.83 1,245,011,652	3.500000 2033/02/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.16%
合計	98.16%

(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	ユーロ買/円売 2026年 7月	買建	3,288,000	607,102,230	609,351,084	0.14%
		豪ドル買/円売 2026年 7月	買建	678,000	76,065,205	75,599,173	0.02%
		韓国ウォン買/円売 2026年7月	買建	8,798,414,000	921,281,929	921,581,076	0.22%
		米ドル買/円売 2026年 7月	買建	4,176,000	673,420,085	677,996,587	0.16%
		カナダ・ドル買/円売 2026年7月	買建	657,000	75,024,095	74,984,142	0.02%

イスラエル・シェケル 買/円売 2026年7月	買建	740,000	41,834,494	40,183,406	0.01%
スウェーデン・クロー ネ買/円売 2026年7月	買建	5,290,000	91,102,264	88,385,320	0.02%
オフショア人民元買/ 円売 2026年7月	買建	18,919,000	447,236,975	451,158,846	0.11%
ニュージーランド・ド ル買/円売 2026年7月	買建	40,000	3,805,656	3,664,480	0.00%
英ポンド買/円売 2026 年7月	買建	1,628,000	348,232,845	349,956,381	0.08%
シンガポール・ドル 買/円売 2026年7月	買建	345,000	43,042,511	43,304,400	0.01%
マレーシア・リングギ ット売/円買 2026年7月	売建	2,612,000	104,192,680	104,532,240	△0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		111,658,805,120	87.75
	内 日本	111,658,805,120	87.75
地方債証券		4,857,827,900	3.82
	内 日本	4,857,827,900	3.82
特殊債券		3,964,056,404	3.12
	内 日本	3,964,056,404	3.12
社債券		6,240,438,100	4.90
	内 日本	6,240,438,100	4.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		519,114,664	0.41
純資産総額		127,240,242,188	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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	158 5年国債	日本	国債証券	2,350,000,000	97.90 2,300,774,500	97.93 2,301,449,000	0.100000 2028/03/20	1.81
2	163 5年国債	日本	国債証券	2,190,000,000	98.03 2,147,026,000	97.79 2,141,644,800	0.400000 2028/09/20	1.68
3	154 5年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	98.45 1,870,588,000	98.67 1,874,825,000	0.100000 2027/09/20	1.47
4	156 5年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	98.38 1,839,762,100	98.44 1,840,828,000	0.200000 2027/12/20	1.45
5	178 5年国債	日本	国債証券	1,700,000,000	98.41 1,673,083,000	97.51 1,657,806,000	1.000000 2030/03/20	1.30
6	365 10年国債	日本	国債証券	1,740,000,000	91.69 1,595,493,000	90.22 1,569,984,600	0.100000 2031/12/20	1.23
7	369 10年国債	日本	国債証券	1,730,000,000	92.44 1,599,274,500	90.14 1,559,422,000	0.500000 2032/12/20	1.23
8	360 10年国債	日本	国債証券	1,620,000,000	94.08 1,524,241,800	93.14 1,508,965,200	0.100000 2030/09/20	1.19
9	370 10年国債	日本	国債証券	1,670,000,000	91.95 1,535,676,000	89.57 1,495,952,600	0.500000 2033/03/20	1.18
10	362 10年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	93.26 1,473,660,700	91.96 1,453,078,600	0.100000 2031/03/20	1.14
11	373 10年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	91.54 1,464,666,800	88.28 1,412,608,000	0.600000 2033/12/20	1.11
12	164 5年国債	日本	国債証券	1,420,000,000	97.18 1,380,020,400	96.98 1,377,158,600	0.200000 2028/12/20	1.08
13	372 10年国債	日本	国債証券	1,520,000,000	93.15 1,416,031,600	90.23 1,371,572,000	0.800000 2033/09/20	1.08
14	377 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	94.35 1,415,382,000	90.31 1,354,680,000	1.200000 2034/12/20	1.06
15	367 10年国債	日本	国債証券	1,470,000,000	91.37 1,343,198,200	89.54 1,316,238,000	0.200000 2032/06/20	1.03
16	169 5年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	97.66 1,318,543,200	97.38 1,314,738,000	0.500000 2029/03/20	1.03
17	161 5年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	98.11 1,275,482,000	97.91 1,272,947,000	0.300000 2028/06/20	1.00

18	174 5年国債	日本	国債証券	1,260,000,000	97.80 1,232,316,800	97.24 1,225,249,200	0.700000 2029/09/20	0.96
19	371 10年国債	日本	国債証券	1,380,000,000	91.05 1,256,526,500	88.26 1,218,098,400	0.400000 2033/06/20	0.96
20	376 10年国債	日本	国債証券	1,370,000,000	92.39 1,265,829,000	88.63 1,214,285,800	0.900000 2034/09/20	0.95
21	366 10年国債	日本	国債証券	1,340,000,000	91.82 1,230,494,200	90.16 1,208,170,800	0.200000 2032/03/20	0.95
22	358 10年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	94.90 1,214,784,000	94.30 1,207,116,800	0.100000 2030/03/20	0.95
23	368 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	90.91 1,227,299,000	88.93 1,200,582,000	0.200000 2032/09/20	0.94
24	364 10年国債	日本	国債証券	1,320,000,000	92.23 1,217,534,000	90.82 1,198,863,600	0.100000 2031/09/20	0.94
25	374 10年国債	日本	国債証券	1,320,000,000	92.59 1,222,248,100	89.08 1,175,961,600	0.800000 2034/03/20	0.92
26	363 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	92.61 1,092,901,100	91.43 1,078,885,800	0.100000 2031/06/20	0.85
27	181 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	99.63 1,096,029,000	97.96 1,077,571,000	1.300000 2030/09/20	0.85
28	378 10年国債	日本	国債証券	1,175,000,000	96.24 1,130,923,000	91.34 1,073,256,750	1.400000 2035/03/20	0.84
29	381 10年国債	日本	国債証券	1,110,000,000	98.78 1,096,513,600	95.69 1,062,170,100	2.100000 2035/12/20	0.83
30	183 5年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	99.83 1,068,191,000	98.92 1,058,508,200	1.600000 2030/12/20	0.83

(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	87.75%
地方債証券	3.82%
特殊債券	3.12%
社債券	4.90%
合計	99.59%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		97,985,871,300	98.98
	内 ガーンジー	867,820,840	0.88
	内 香港	1,970,399,634	1.99
	内 シンガポール	6,671,903,334	6.74
	内 イギリス	9,093,969,124	9.19
	内 オランダ	514,614,470	0.52
	内 ベルギー	2,968,078,027	3.00
	内 フランス	5,229,888,402	5.28
	内 スペイン	1,339,802,193	1.35
	内 カナダ	1,906,526,266	1.93
	内 アメリカ	50,037,975,589	50.55
	内 オーストラリア	16,852,883,766	17.02
	内 ニュージーランド	532,009,655	0.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,006,695,705	1.02
純資産総額		98,992,567,005	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）		178,717,473	0.18
	内 日本	178,717,473	0.18
為替予約取引（売建）		178,949,855	△0.18
	内 日本	178,949,855	△0.18

（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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	投資証券	223,885	33,670.10 7,538,237,582	36,981.07 8,279,507,909	8.36
2	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	投資証券	2,168,650	2,884.94 6,256,575,064	3,581.07 7,766,100,467	7.85
3	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	159,282	29,201.78 4,651,322,759	30,948.28 4,929,504,923	4.98
4	PROLOGIS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	153,041	21,394.72 3,274,292,701	22,554.34 3,451,739,835	3.49
5	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	オーストラリア	投資証券	7,670,585	393.58 3,019,732,862	437.31 3,354,463,413	3.39
6	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	シンガポール	投資証券	10,335,200	292.86 3,027,019,795	300.01 3,100,732,598	3.13
7	KLEPIERRE REIT SA (REIT)	フランス	投資証券	371,668	6,017.57 2,236,553,125	6,876.48 2,555,769,427	2.58
8	CROWN CASTLE INC (REIT)	アメリカ	投資証券	180,501	14,225.68 2,567,755,751	12,768.72 2,304,767,758	2.33
9	EQUINIX REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	12,784	157,502.06 2,013,506,348	176,220.75 2,252,806,149	2.28
10	KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	517,170	3,726.85 1,927,437,071	4,194.53 2,169,286,994	2.19
11	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	103,576	16,601.05 1,719,478,536	19,063.24 1,974,494,923	1.99
12	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	香港	投資証券	2,585,392	767.13 1,983,416,343	762.12 1,970,399,634	1.99
13	SEGRO REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	1,043,034	1,544.27 1,610,882,760	1,888.56 1,969,841,781	1.99
14	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	48,594	30,241.72 1,469,573,422	36,953.46 1,795,716,843	1.81
15	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	33,268	48,490.14 1,613,172,250	52,687.43 1,752,805,604	1.77
16	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	72,288	22,957.07 1,659,520,987	24,075.94 1,740,401,652	1.76

17	BXP INC (REIT)	アメリカ	投資証券	152,399	8,453.37 1,288,287,660	10,891.49 1,659,853,297	1.68
18	TRITAX BIG BOX REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	4,632,219	324.94 1,505,920,504	349.88 1,620,750,198	1.64
19	AEDIFICA NV (REIT)	ベルギー	投資証券	114,751	13,319.80 1,528,477,237	13,298.86 1,526,057,771	1.54
20	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I (REIT)	アメリカ	投資証券	143,390	10,992.34 1,576,198,256	10,505.00 1,506,313,255	1.52
21	CAPITALAND ASCENDAS REIT	シンガポール	投資証券	4,679,200	306.41 1,434,030,780	318.84 1,491,945,139	1.51
22	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	30,701	40,589.38 1,246,134,571	48,056.07 1,475,369,488	1.49
23	SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	69,275	21,729.73 1,505,328,559	19,686.53 1,363,785,038	1.38
24	MERLIN PROPERTIES REIT SA (REIT)	スペイン	投資証券	468,167	2,463.30 1,153,319,664	2,861.80 1,339,802,193	1.35
25	AGREE REALTY REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	106,419	12,840.50 1,366,479,871	12,492.66 1,329,456,672	1.34
26	INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED	オーストラリア	投資証券	2,610,123	454.27 1,185,867,367	503.13 1,313,245,802	1.33
27	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	オーストラリア	投資証券	2,815,663	504.47 1,420,709,933	465.20 1,309,861,069	1.32
28	BRITISH LAND REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	1,457,803	787.51 1,148,304,341	892.45 1,301,027,221	1.31
29	IRON MOUNTAIN INC (REIT)	アメリカ	投資証券	61,259	17,349.74 1,062,828,188	21,105.82 1,292,921,936	1.31
30	CHARTER HALL GROUP STAPLED UNITS	オーストラリア	投資証券	494,724	2,192.15 1,084,532,580	2,579.26 1,276,025,386	1.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.98%
合計	98.98%

(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	英ポンド買/円売 2026年7月	買建	831,119	178,964,182	178,717,473	0.18%
		米ドル売/円買 2026年7月	売建	1,102,064	178,964,182	178,949,855	△0.18%

(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（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		195,258,702,450	97.61
	内 日本	195,258,702,450	97.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,778,240,916	2.39
純資産総額		200,036,943,366	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）		3,753,750,000	1.88
	内 日本	3,753,750,000	1.88

(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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	137,779	128,411.72 17,692,439,479	125,900.00 17,346,376,100	8.67
2	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	131,088	114,378.77 14,993,684,697	112,100.00 14,694,964,800	7.35
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	80,806	157,420.49 12,720,520,730	151,800.00 12,266,350,800	6.13
4	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	103,376	116,737.31 12,067,837,034	115,800.00 11,970,940,800	5.98
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	73,428	159,784.78 11,732,677,143	154,900.00 11,373,997,200	5.69
6	GLP投資法人	日本	投資証券	71,985	135,471.90 9,751,945,009	137,400.00 9,890,739,000	4.94
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	80,749	122,848.12 9,919,863,071	120,500.00 9,730,254,500	4.86
8	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	119,516	77,109.83 9,215,858,849	79,300.00 9,477,618,800	4.74
9	日本プロロジスリート	日本	投資証券	100,278	88,641.04 8,888,746,780	86,800.00 8,704,130,400	4.35
10	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	123,603	60,988.81 7,538,400,859	59,800.00 7,391,459,400	3.70
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	78,134	98,086.33 7,663,877,871	93,300.00 7,289,902,200	3.64
12	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	56,390	130,075.50 7,334,957,880	121,900.00 6,873,941,000	3.44
13	オリックス不動産投資	日本	投資証券	50,813	97,438.65 4,951,150,176	97,500.00 4,954,267,500	2.48
14	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	39,825	121,155.70 4,825,025,820	119,500.00 4,759,087,500	2.38
15	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	30,021	159,688.47 4,794,007,591	150,400.00 4,515,158,400	2.26
16	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	43,081	108,406.15 4,670,245,392	103,300.00 4,450,267,300	2.22
17	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	43,663	93,867.25 4,098,525,860	94,900.00 4,143,618,700	2.07
18	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	25,338	150,094.16 3,803,085,931	146,000.00 3,699,348,000	1.85

19	日本リート投資法人	日本	投資証券	41,945	88,149.07 3,697,412,929	83,700.00 3,510,796,500	1.76
20	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	23,574	135,335.95 3,190,409,761	136,200.00 3,210,778,800	1.61
21	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	38,899	84,477.02 3,286,071,767	80,400.00 3,127,479,600	1.56
22	スターアジア不動産投	日本	投資証券	52,685	55,710.33 2,935,099,214	55,000.00 2,897,675,000	1.45
23	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	26,207	105,181.62 2,756,494,903	99,500.00 2,607,596,500	1.30
24	産業ファンド	日本	投資証券	17,126	143,176.65 2,452,043,445	141,900.00 2,430,179,400	1.21
25	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,249	330,555.94 2,396,200,011	327,000.00 2,370,423,000	1.18
26	CREロジスティクスファンド	日本	投資証券	16,404	151,342.32 2,482,619,508	140,400.00 2,303,121,600	1.15
27	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	16,355	142,974.91 2,338,354,768	137,000.00 2,240,635,000	1.12
28	いちごオフィスリート投資法人	日本	投資証券	22,559	88,784.10 2,002,880,610	93,100.00 2,100,242,900	1.05
29	API投資法人	日本	投資証券	15,251	137,634.52 2,099,064,218	137,100.00 2,090,912,100	1.05
30	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	10,118	158,405.83 1,602,750,225	155,300.00 1,571,325,400	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.61%
合計	97.61%

(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 0809月	買建	2,100	3,650,451,000	3,753,750,000	1.88%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		7,816,492,982	78.43
	内 カナダ	205,020,320	2.06
	内 アメリカ	7,611,472,662	76.37
優先出資証券		1,993,973,835	20.01
	内 アメリカ	1,993,973,835	20.01
投資証券		55,649,729	0.56
	内 アメリカ	55,649,729	0.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		100,016,291	1.00
純資産総額		9,966,132,837	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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	19,000	31,896.48 606,034,608	31,661.17 601,562,388	6.04
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	12,000	42,031.40 504,376,844	45,751.75 549,021,103	5.51

3	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	9,000	54,061.25 486,551,294	57,429.22 516,863,012	5.19
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	7,500	40,793.34 305,950,738	38,996.33 292,472,510	2.93
5	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	4,500	63,837.13 287,267,098	59,852.08 269,334,370	2.70
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	4,000	62,350.93 249,404,083	60,482.15 241,928,622	2.43
7	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	3,100	50,522.77 156,620,608	53,489.64 165,817,891	1.66
8	CATERPILLAR INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	900	128,978.25 116,080,432	167,779.72 151,001,752	1.52
9	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	700	151,698.56 106,189,094	199,728.33 139,809,833	1.40
10	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	3,900	29,772.58 116,113,072	34,381.21 134,086,722	1.35
11	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	700	172,075.91 120,453,208	185,982.01 130,187,413	1.31
12	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	1,400	41,420.81 57,989,144	87,607.78 122,650,894	1.23
13	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,800	59,142.43 106,456,388	66,878.69 120,381,656	1.21
14	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,800	38,989.83 109,171,549	41,979.43 117,542,429	1.18
15	APPLIED MATERIAL INC	アメリカ	株式	情報技術	1,000	64,247.97 64,247,980	112,802.58 112,802,590	1.13
16	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	2,000	51,353.23 102,706,706	55,480.54 110,961,087	1.11
17	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	1,200	107,581.75 129,098,101	91,360.61 109,632,737	1.10
18	LAM RESEARCH CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,300	44,175.60 57,428,477	66,727.67 86,745,977	0.87
19	QUALCOMM INC	アメリカ	株式	情報技術	2,700	22,841.61 61,672,716	30,646.24 82,744,850	0.83
20	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	1,000	77,547.72 77,547,721	80,545.44 80,545,440	0.81

21	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	470	147,714.81 69,425,963	165,671.90 77,865,794	0.78
22	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS IN (Pfd)	アメリカ	優先出資証券	—	19,490	4,078.58 79,493,765	3,974.49 77,462,912	0.78
23	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO	アメリカ	株式	情報技術	1,700	39,017.44 66,329,657	45,144.42 76,745,514	0.77
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	3,900	13,415.03 52,318,648	19,113.30 74,541,882	0.75
25	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	2,700	30,370.17 81,999,480	27,357.84 73,866,177	0.74
26	MORGAN STANLEY (Pfd)	アメリカ	優先出資証券	—	17,638	4,158.48 73,349,004	4,186.41 73,839,974	0.74
27	DTE ENERGY COMPANY (Pfd)	アメリカ	優先出資証券	—	18,788	4,000.47 75,163,225	3,858.38 72,491,364	0.73
28	REGIONS FINANCIAL CORPORATION (Pfd)	アメリカ	優先出資証券	—	18,139	3,980.17 72,196,465	3,965.56 71,931,362	0.72
29	REINSURANCE GROUP OF AMERICA INCOR (Pfd)	アメリカ	優先出資証券	—	17,030	4,127.95 70,299,053	4,184.79 71,266,979	0.72
30	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	3,200	24,235.08 77,552,268	22,094.78 70,703,307	0.71

(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	78.43%
優先出資証券	20.01%
投資証券	0.56%
合計	99.00%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.85%
素材	2.20%
資本財・サービス	7.28%
一般消費財・サービス	7.73%
生活必需品	3.14%
ヘルスケア	7.30%
金融	9.78%

情報技術	28.72%
コミュニケーション・サービス	7.52%
公益事業	1.92%
合計	78.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		2,425,658,426	93.71
	内 スウェーデン	50,537,749	1.95
	内 イギリス	589,181,153	22.76
	内 オランダ	170,787,297	6.60
	内 フランス	592,626,736	22.90
	内 ドイツ	374,556,822	14.47
	内 スイス	361,113,018	13.95
	内 スペイン	60,282,932	2.33
	内 イタリア	226,572,719	8.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		162,791,243	6.29
純資産総額		2,588,449,669	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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

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

1	SIEMENS N AG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,562	43,974.28 112,662,125	49,896.22 127,834,116	4.94
2	NOVARTIS AG	スイス	株式	ヘルスケア	4,813	24,170.26 116,331,490	25,359.89 122,057,151	4.72
3	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	35,981	2,891.99 104,056,779	3,061.88 110,169,571	4.26
4	NESTLE SA	スイス	株式	生活必需品	6,118	15,961.45 97,652,203	16,940.08 103,639,440	4.00
5	SCHNEIDER ELECTRIC	フランス	株式	資本財・サービス	1,792	49,590.39 88,865,983	51,545.83 92,370,136	3.57
6	ENEL	イタリア	株式	公益事業	49,171	1,831.44 90,053,901	1,872.40 92,068,060	3.56
7	ASTRAZENECA PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	2,802	32,081.15 89,891,408	30,747.84 86,155,473	3.33
8	ALLIANZ	ドイツ	株式	金融	1,104	71,174.40 78,576,538	75,771.08 83,651,272	3.23
9	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	73,727	1,068.54 78,780,450	1,093.56 80,625,267	3.11
10	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	642	111,044.97 71,290,871	119,082.97 76,451,267	2.95
11	AXA SA	フランス	株式	金融	9,407	7,753.19 72,934,263	8,042.33 75,654,259	2.92
12	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	89,223	883.93 78,867,255	821.28 73,277,587	2.83
13	TOTALENERGIES	フランス	株式	エネルギー	5,604	14,344.23 80,385,101	12,785.44 71,649,623	2.77
14	DEUTSCHE TELEKOM N AG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	15,388	5,326.95 81,971,245	4,600.38 70,790,755	2.73
15	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	24,842	2,815.43 69,941,025	2,697.80 67,018,803	2.59
16	LLOYDS BANKING GROUP PLC	イギリス	株式	金融	275,268	221.50 60,972,275	233.97 64,405,664	2.49
17	SHELL PLC	イギリス	株式	エネルギー	9,808	7,259.01 71,196,397	6,237.52 61,177,648	2.36
18	GLAXOSMITHKLINE	イギリス	株式	ヘルスケア	13,944	4,709.59 65,670,593	4,256.91 59,358,419	2.29

19	BNP PARIBAS SA	フランス	株式	金融	3,187	16,887.23 53,819,629	18,601.72 59,283,701	2.29
20	GIVAUDAN SA	スイス	株式	素材	86	576,525.55 49,581,197	685,641.40 58,965,160	2.28
21	MICHELIN	フランス	株式	一般消費 財・サービ ス	9,451	5,675.41 53,638,366	6,190.69 58,508,211	2.26
22	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESE	ドイツ	株式	金融	636	103,944.28 66,108,562	89,950.35 57,208,426	2.21
23	M&G PLC	イギリス	株式	金融	75,373	635.25 47,881,278	715.90 53,959,638	2.08
24	ENI	イタリア	株式	エネル ギー	14,180	4,352.94 61,724,757	3,799.67 53,879,392	2.08
25	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	170	302,100.29 51,357,058	298,784.20 50,793,314	1.96
26	VINCI SA	フランス	株式	資本財・ サービス	2,152	23,828.03 51,278,051	23,511.64 50,597,065	1.95
27	VOLVO CLASS B	スウェーデ ン	株式	資本財・ サービス	9,349	5,374.57 50,246,885	5,405.68 50,537,749	1.95
28	DANONE SA	フランス	株式	生活必需 品	3,722	12,518.53 46,594,002	13,352.61 49,698,429	1.92
29	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	オランダ	株式	生活必需 品	7,134	7,603.05 54,240,209	6,548.41 46,716,396	1.80
30	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需 品	46,153	997.61 46,046,852	991.38 45,755,184	1.77

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.71%
合計	93.71%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	7.21%
素材	3.63%
資本財・サービス	13.80%
一般消費財・サービス	3.85%

生活必需品	9.50%
ヘルスケア	11.82%
金融	27.06%
情報技術	3.21%
コミュニケーション・サービス	6.66%
公益事業	6.96%
合計	93.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,023,910,641	98.51
	内 韓国	285,319,511	27.45
	内 台湾	438,801,205	42.22
	内 香港	84,120,934	8.09
	内 シンガポール	72,013,297	6.93
	内 オーストラリア	143,655,694	13.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,477,098	1.49
純資産総額		1,039,387,739	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		3,412,608	△0.33
	内 日本	3,412,608	△0.33

(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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾	株式	情報技術	8,200	10,461.18 85,781,701	12,064.72 98,930,720	9.52
2	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	358	115,563.51 41,371,739	275,340.81 98,572,012	9.48
3	SAMSUNG ELECTRONICS LTD	韓国	株式	情報技術	2,735	21,635.41 59,172,868	33,841.35 92,556,109	8.90
4	ASE TECHNOLOGY HOLDING LTD	台湾	株式	情報技術	22,000	2,158.41 47,485,117	3,191.80 70,219,736	6.76
5	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	2,800	8,755.83 24,516,330	19,904.24 55,731,889	5.36
6	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	4,300	8,908.55 38,306,765	9,697.59 41,699,650	4.01
7	UNITED MICRO ELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	40,000	303.90 12,156,353	834.85 33,394,336	3.21
8	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	3,700	7,211.69 26,683,284	8,288.74 30,668,360	2.95
9	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	4,050	6,258.51 25,346,990	6,673.51 27,027,753	2.60
10	HYUNDAI MOTOR	韓国	株式	一般消費 財・サービス	495	54,774.57 27,113,416	52,071.68 25,775,484	2.48
11	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	14,400	1,801.77 25,945,488	1,495.26 21,531,773	2.07
12	ASUSTEK COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	6,000	2,952.54 17,715,288	3,578.69 21,472,151	2.07
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	台湾	株式	情報技術	17,000	1,056.29 17,957,092	1,254.83 21,332,159	2.05
14	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	オーストラリア	株式	金融	1,150	20,473.49 23,544,515	18,252.33 20,990,181	2.02
15	FUBON FINANCIAL HOLDING LTD	台湾	株式	金融	30,415	445.93 13,563,160	654.14 19,895,732	1.91
16	OVERSEA-CHINESE BANKING LTD	シンガポール	株式	金融	6,000	2,872.12 17,232,758	3,123.18 18,739,118	1.80

17	WOORI FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	5,600	3,606.91 20,198,744	3,048.86 17,073,645	1.64
18	SK TELECOM LTD	韓国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	1,800	10,005.72 18,010,307	9,450.43 17,010,782	1.64
19	MACQUARIE GROUP LTD DEF	オーストラ リア	株式	金融	600	26,040.66 15,624,409	27,891.11 16,734,669	1.61
20	QBE INSURANCE GROUP LTD	オーストラ リア	株式	金融	5,800	2,546.91 14,772,106	2,784.53 16,150,318	1.55
21	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	台湾	株式	情報技術	4,000	2,667.47 10,669,898	3,985.93 15,943,759	1.53
22	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	台湾	株式	情報技術	3,000	3,039.08 9,117,265	4,968.42 14,905,277	1.43
23	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	900	16,359.78 14,723,806	16,103.45 14,493,111	1.39
24	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	シンガポー ル	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	24,900	608.82 15,159,630	557.35 13,878,095	1.34
25	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	香港	株式	金融	15,000	919.93 13,799,073	902.95 13,544,340	1.30
26	GLOBAL UNICHIP CORP	台湾	株式	情報技術	600	15,526.33 9,315,798	22,500.45 13,500,271	1.30
27	WESTPAC BANKING CORPORATION	オーストラ リア	株式	金融	3,350	4,627.50 15,502,154	3,931.37 13,170,104	1.27
28	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	香港	株式	不動産	5,500	2,841.41 15,627,766	2,356.79 12,962,389	1.25
29	WESFARMERS LTD	オーストラ リア	株式	一般消費 財・サービ ス	1,240	8,372.57 10,381,997	10,128.53 12,559,380	1.21
30	EVERGREEN MARINE CORP (TAIWAN) LTD	台湾	株式	資本財・ サービス	12,000	1,023.21 12,278,527	936.67 11,240,045	1.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.51%
合計	98.51%

(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	0.89%
素材	4.38%
資本財・サービス	2.10%
一般消費財・サービス	4.65%
金融	21.36%
情報技術	57.61%
コミュニケーション・サービス	2.97%
公益事業	1.22%
不動産	3.32%
合計	98.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2026年7月	売建	21,018	3,400,000	3,412,608	△0.33%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況（2026年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		72,564,183,080	95.75
	内 日本	72,564,183,080	95.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,223,828,350	4.25
純資産総額		75,788,011,430	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（2026年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,249,200	2,919.22 3,646,701,689	3,207.00 4,006,184,400	5.29
2	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	624,600	5,660.70 3,535,677,740	6,346.00 3,963,711,600	5.23
3	東京海上HD	日本	株式	保険業	466,400	6,848.42 3,194,106,518	7,202.00 3,359,012,800	4.43
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	42,800	43,834.95 1,876,136,177	77,150.00 3,302,020,000	4.36
5	住友電工	日本	株式	非鉄金属	1,090,800	2,398.54 2,616,329,443	2,927.00 3,192,771,600	4.21
6	小松製作所	日本	株式	機械	495,600	7,186.29 3,561,527,929	6,282.00 3,113,359,200	4.11
7	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,042,200	3,372.52 3,514,848,402	2,725.00 2,839,995,000	3.75
8	第一ライフグループ	日本	株式	保険業	1,173,800	1,511.43 1,774,121,193	1,778.50 2,087,603,300	2.75
9	T H K	日本	株式	機械	278,500	5,648.23 1,573,032,683	7,322.00 2,039,177,000	2.69
10	三井住友トラストグルー	日本	株式	銀行業	324,100	5,447.10 1,765,408,202	6,057.00 1,963,073,700	2.59
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	344,400	5,643.43 1,943,599,826	5,155.00 1,775,382,000	2.34
12	丸 紅	日本	株式	卸売業	371,900	5,894.00 2,191,980,256	4,690.00 1,744,211,000	2.30
13	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	7,967,300	220.68 1,758,260,749	208.10 1,657,995,130	2.19
14	三井物産	日本	株式	卸売業	350,200	5,887.10 2,061,664,431	4,497.00 1,574,849,400	2.08
15	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	240,100	5,899.87 1,416,560,645	6,012.00 1,443,481,200	1.90

16	鹿島建設	日本	株式	建設業	236,600	6,125.71 1,449,344,660	5,872.00 1,389,315,200	1.83
17	シチズン時計	日本	株式	精密機器	471,100	1,810.42 852,892,761	2,420.00 1,140,062,000	1.50
18	牧野フライス	日本	株式	機械	73,500	13,690.51 1,006,252,990	15,200.00 1,117,200,000	1.47
19	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	504,200	2,353.83 1,186,805,736	2,150.50 1,084,282,100	1.43
20	レンゴー	日本	株式	パルプ・紙	727,200	1,265.52 920,288,725	1,417.50 1,030,806,000	1.36
21	オリックス	日本	株式	その他金融業	161,900	5,054.65 818,348,818	6,149.00 995,523,100	1.31
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	344,500	2,635.79 908,032,395	2,745.00 945,652,500	1.25
23	INPEX	日本	株式	鉱業	284,300	4,030.35 1,145,829,300	3,265.00 928,239,500	1.22
24	丸井グループ	日本	株式	小売業	319,500	3,054.37 975,872,977	2,864.50 915,207,750	1.21
25	関電工	日本	株式	建設業	135,300	6,108.54 826,486,102	6,722.00 909,486,600	1.20
26	小野薬品	日本	株式	医薬品	366,900	2,351.30 862,695,315	2,388.00 876,157,200	1.16
27	オーエスジー	日本	株式	機械	228,900	2,958.55 677,212,377	3,632.00 831,364,800	1.10
28	豊田通商	日本	株式	卸売業	136,300	6,255.23 852,588,113	5,978.00 814,801,400	1.08
29	中部電力	日本	株式	電気・ガス業	264,500	2,764.64 731,247,350	3,060.00 809,370,000	1.07
30	ふくおかフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	114,800	6,606.93 758,476,103	6,837.00 784,887,600	1.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.75%
合計	95.75%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	1.22%
建設業	4.63%
食料品	2.97%
繊維製品	0.27%
パルプ・紙	1.36%
化学	2.12%
医薬品	3.50%
ゴム製品	0.35%
ガラス・土石製品	0.72%
鉄鋼	1.49%
非鉄金属	4.75%
金属製品	0.96%
機械	11.81%
電気機器	8.93%
輸送用機器	5.97%
精密機器	1.50%
その他製品	0.47%
電気・ガス業	1.07%
陸運業	0.71%
情報・通信業	4.93%
卸売業	6.58%
小売業	1.95%
銀行業	15.67%
証券、商品先物取引業	0.29%
保険業	7.56%
その他金融業	1.31%
不動産業	2.24%
サービス業	0.41%
合計	95.75%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース)

2026年6月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	26,007円
純資産総額	137億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	4.8%
6カ月間	3.6%
1年間	13.6%
3年間	25.7%
5年間	33.6%
設定来	160.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円

設定来分配金合計額：0円

決算期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期
	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月	22年1月	23年1月	24年1月	25年1月	26年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
外国債券	1,127	24.4%	日本円	49.6%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
国内債券	398	24.1%	米ドル	27.2%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.5%
外国リート	72	15.4%	ユーロ	9.8%	修正デュレーション	NVIDIA CORP	アメリカ	0.5%
国内リート・先物	44	14.4%	英ポンド	3.3%	残存年数	東京海上HD	日本	0.4%
国内株式	90	9.6%	オフショア人民元	3.2%	債券格付別構成	APPLE INC	アメリカ	0.4%
外国株式	222	8.2%	豪ドル	3.0%	AAA	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	1.3%
外国優先出資証券	67	1.6%	シンガポール・ドル	1.0%	AA	日本ビルファンド	日本	1.3%
			カナダ・ドル	0.9%	A	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	1.2%
			香港ドル	0.3%	BBB	日本都市ファンド投資法人	日本	1.1%
コール・ローン、その他		2.6%	その他	1.6%	BB以下・無格付	野村不動産マスターフ	日本	0.9%
合計	2,020	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	8.1%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を0.9%保有しております。

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

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2026年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）】

(1) 【投資状況】（2026年6月30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	17,596,577,542	99.13
内 日本	17,596,577,542	99.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	155,244,541	0.87
純資産総額	17,751,822,083	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】（2026年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	521,991,647	5.2522 2,741,630,454	5.9069 3,083,352,459	17.37
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	313,080,970	8.6634 2,712,345,700	9.8116 3,071,825,245	17.30
3	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	684,434,551	4.1143 2,816,018,433	4.2359 2,899,196,314	16.33
4	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	2,561,582,551	1.1118 2,848,210,247	1.0888 2,789,051,081	15.71
5	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	690,491,343	4.3218 2,984,191,517	3.9543 2,730,409,917	15.38
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	263,229,932	8.5517 2,251,083,502	9.1202 2,400,709,625	13.52
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	116,515,894	4.1390 482,268,946	4.4360 516,864,505	2.91
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,990,633	6.6016 65,954,190	10.5267 105,168,396	0.59

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.13%
合計	99.13%

(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11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
第15計算期間末 (2021年1月12日)	6,484,800,717	6,484,800,717	1.8830	1.8830
第16計算期間末 (2022年1月11日)	8,604,019,799	8,604,019,799	2.1960	2.1960
第17計算期間末 (2023年1月10日)	9,398,811,297	9,398,811,297	2.0999	2.0999
第18計算期間末 (2024年1月10日)	11,710,771,031	11,710,771,031	2.4153	2.4153
第19計算期間末 (2025年1月10日)	13,625,241,353	13,625,241,353	2.6376	2.6376
2025年6月末日	14,278,589,962	—	2.6799	—

7月末日	14,820,606,371	—	2.7604	—
8月末日	15,082,774,700	—	2.8098	—
9月末日	15,330,805,651	—	2.8480	—
10月末日	15,948,798,491	—	2.9375	—
11月末日	16,353,258,610	—	3.0046	—
12月末日	16,527,336,592	—	3.0183	—
第20計算期間末 (2026年1月13日)	16,783,673,843	16,783,673,843	3.0744	3.0744
2026年1月末日	16,618,299,226	—	3.0274	—
2月末日	17,426,244,785	—	3.1693	—
3月末日	16,542,727,685	—	2.9919	—
4月末日	17,291,158,300	—	3.1132	—
5月末日	17,496,740,701	—	3.1455	—
6月末日	17,751,822,083	—	3.1885	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	6.7
第12計算期間	7.9
第13計算期間	△6.2
第14計算期間	14.7
第15計算期間	△0.3
第16計算期間	16.6
第17計算期間	△4.4
第18計算期間	15.0
第19計算期間	9.2

第20計算期間	16.6
---------	------

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第11計算期間	489,108,988	304,974,316
第12計算期間	577,484,738	415,195,786
第13計算期間	682,462,389	295,483,585
第14計算期間	853,612,726	397,196,903
第15計算期間	998,812,762	616,961,375
第16計算期間	906,065,649	431,848,512
第17計算期間	926,048,289	368,363,492
第18計算期間	850,834,868	478,063,755
第19計算期間	844,341,408	527,174,366
第20計算期間	786,610,685	493,163,080

(参考) マザーファンド**外国債券インデックスマザーファンド**

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース)

2026年6月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	31,885円
純資産総額	177億円

基準価額の増減率

期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	6.6%
6カ月間	5.6%
1年間	19.0%
3年間	37.6%
5年間	50.7%
設定来	218.9%



※上記の「基準価額の増減率」とは、

「分配金再投資基準価額」の増減率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。

※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期
	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月	22年1月	23年1月	24年1月	25年1月	26年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
外国リート	72	17.3%	日本円	49.4%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
国内株式	90	16.6%	米ドル	29.7%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%
外国債券	1,127	16.0%	ユーロ	8.2%	修正デュレーション	NVIDIA CORP	アメリカ	0.8%
国内債券	398	15.6%	英ポンド	3.3%	残存年数	東京海上HD	日本	0.8%
国内リート・先物	44	15.3%	豪ドル	3.3%	債券格付別構成	東京エレクトロン	日本	0.8%
外国株式	222	13.9%	オフショア人民元	2.1%	AAA	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	1.5%
外国優先出資証券	67	2.7%	シンガポール・ドル	1.1%	AA	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	1.4%
			カナダ・ドル	0.8%	A	日本ビルファンド	日本	1.3%
			スイス・フラン	0.4%	BBB	日本都市ファンド投資法人	日本	1.1%
コール・ローン、その他		2.8%	その他	1.7%	BB以下・無格付	野村不動産マスターF	日本	0.9%
合計	2,020	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	10.4%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を0.9%保有しております。

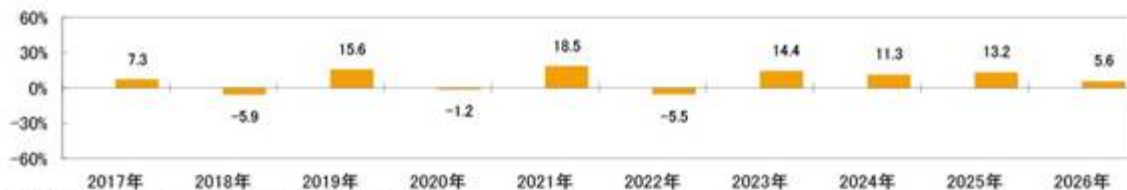
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の増減率です。

・2026年は6月30日までの増減率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)】

(1) 【投資状況】 (2026年6月30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	28,941,846,400	99.13
内 日本	28,941,846,400	99.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	255,193,702	0.87
純資産総額	29,197,040,102	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】（2026年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	760,007,668	8.6634 6,584,250,479	9.8116 7,456,891,235	25.54
2	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,017,540,139	5.2525 5,344,704,427	5.9069 6,010,507,847	20.59
3	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	643,269,118	8.5531 5,501,968,035	9.1202 5,866,743,009	20.09
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	1,349,897,381	4.3185 5,829,577,417	3.9543 5,337,899,213	18.28
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	335,079,129	4.1145 1,378,693,780	4.2359 1,419,361,682	4.86
6	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,247,184,592	1.1117 1,386,528,729	1.0888 1,357,934,583	4.65
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	281,718,528	4.1388 1,165,979,429	4.4360 1,249,703,390	4.28
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,065,675	6.6016 152,270,396	10.5267 242,805,441	0.83

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.13%
合計	99.13%

(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11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
第15計算期間末 (2021年1月12日)	7,237,633,493	7,237,633,493	2.0216	2.0216
第16計算期間末 (2022年1月11日)	10,544,787,720	10,544,787,720	2.4728	2.4728
第17計算期間末 (2023年1月10日)	12,038,049,728	12,038,049,728	2.3715	2.3715
第18計算期間末 (2024年1月10日)	15,653,816,556	15,653,816,556	2.8278	2.8278
第19計算期間末 (2025年1月10日)	21,624,961,028	21,624,961,028	3.1960	3.1960
2025年6月末日	22,699,584,797	—	3.2759	—
7月末日	23,729,054,236	—	3.4061	—

8月末日	24,369,449,329	—	3.4940	—
9月末日	24,829,897,659	—	3.5509	—
10月末日	25,884,795,079	—	3.6798	—
11月末日	26,639,010,879	—	3.7886	—
12月末日	27,019,865,747	—	3.8209	—
第20計算期間末 (2026年1月13日)	27,594,962,350	27,594,962,350	3.9190	3.9190
2026年1月末日	27,216,501,228	—	3.8557	—
2月末日	28,781,849,695	—	4.0822	—
3月末日	26,843,298,552	—	3.7941	—
4月末日	28,312,044,578	—	4.0000	—
5月末日	28,753,076,652	—	4.0685	—
6月末日	29,197,040,102	—	4.1304	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	9.2
第12計算期間	11.1
第13計算期間	△8.5
第14計算期間	18.5
第15計算期間	△0.8
第16計算期間	22.3
第17計算期間	△4.1
第18計算期間	19.2
第19計算期間	13.0
第20計算期間	22.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第11計算期間	433,420,891	252,225,036
第12計算期間	541,348,837	363,638,097
第13計算期間	676,061,653	274,586,229
第14計算期間	898,116,398	365,651,278
第15計算期間	1,060,242,411	584,120,737
第16計算期間	1,096,214,144	412,115,894
第17計算期間	1,255,999,989	444,192,637
第18計算期間	1,000,538,169	541,007,076
第19計算期間	1,887,298,973	656,638,781
第20計算期間	971,685,316	696,644,690

(参考) マザーファンド**外国債券インデックスマザーファンド**

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース)

2026年6月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	41,304円
純資産総額	291億円

基準価額の増減率

期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	8.9%
6カ月間	8.1%
1年間	26.1%
3年間	54.7%
5年間	76.0%
設定来	313.0%



※上記の「基準価額の増減率」とは、

「分配金再投資基準価額」の増減率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。

※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第9期 15年1月	第10期 16年1月	第11期 17年1月	第12期 18年1月	第13期 19年1月	第14期 20年1月	第15期 21年1月	第16期 22年1月	第17期 23年1月	第18期 24年1月	第19期 25年1月	第20期 26年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	90	24.5%	日本円	49.5%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.4%
外国株式	222	20.6%	米ドル	32.7%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	1.3%
外国リート	72	20.5%	ユーロ	6.1%	修正デュレーション	NVIDIA CORP	アメリカ	1.2%
国内リート・先物	44	18.2%	豪ドル	3.7%	残存年数	東京海上HD	日本	1.1%
外国債券	1,127	4.8%	英ポンド	3.3%	債券格付別構成	東京エレクトロン	日本	1.1%
国内債券	398	4.6%	シンガポール・ドル	1.3%	AAA	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	1.7%
外国優先出資証券	67	4.0%	カナダ・ドル	0.7%	AA	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	1.6%
			スイス・フラン	0.6%	A	日本ビルファンド	日本	1.6%
			オフショア人民元	0.6%	BBB	日本都市ファンド投資法人	日本	1.3%
コール・ローン、その他		3.2%	その他	1.5%	BB以下・無格付	野村不動産マスターF	日本	1.1%
合計	2,020	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	13.5%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を0.9%保有しております。

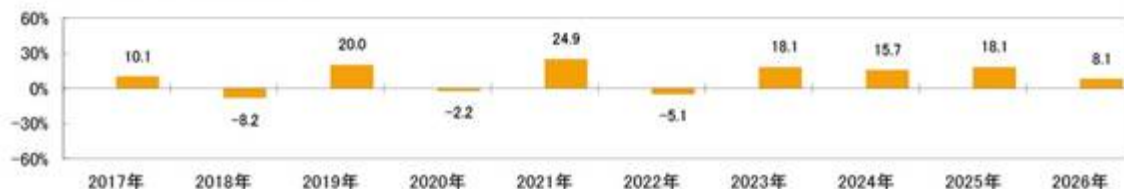
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の増減率です。

・2026年は6月30日までの増減率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

〈参考情報〉ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1.01%	0.99%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1.17%	1.15%	0.02%
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	1.34%	1.32%	0.02%

※対象期間は2025年1月11日～2026年1月13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】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

・海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・公社債等：原則として次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
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を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・ 委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 公告

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

<収益分配金にかかる請求権>

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

<償還金にかかる請求権>

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

【D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2025年1月11日から2026年1月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	155,135,140	187,534,794
親投資信託受益証券	10,959,881,175	13,177,667,479
未収入金	1,903,000	118,681,000
流動資産合計	11,116,919,315	13,483,883,273
資産合計	11,116,919,315	13,483,883,273
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,073,711	125,940,302
未払受託者報酬	2,996,253	3,543,307
未払委託者報酬	50,937,068	60,236,867
その他未払費用	449,359	531,409
流動負債合計	57,456,391	190,251,885
負債合計	57,456,391	190,251,885
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 4,882,340,404	※ 1 5,229,242,455
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,177,122,520	8,064,388,933
（分配準備積立金）	2,184,693,082	3,371,183,692
元本等合計	11,059,462,924	13,293,631,388
純資産合計	11,059,462,924	13,293,631,388
負債純資産合計	11,116,919,315	13,483,883,273

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期 自 2024年1月11日 至 2025年1月10日	第20期 自 2025年1月11日 至 2026年1月13日
営業収益		
受取利息	172,966	698,564
有価証券売買等損益	733,750,173	1,557,991,304
営業収益合計	733,923,139	1,558,689,868
営業費用		
支払利息	1,195	-
受託者報酬	5,823,842	6,593,671
委託者報酬	※ 1 99,006,792	※ 1 112,093,874
その他費用	873,412	988,882
営業費用合計	105,705,241	119,676,427
営業利益又は営業損失（△）	628,217,898	1,439,013,441
経常利益又は経常損失（△）	628,217,898	1,439,013,441
当期純利益又は当期純損失（△）	628,217,898	1,439,013,441
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（△）	54,018,333	46,424,865
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,191,859,939	6,177,122,520
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,036,688,169	1,136,448,708
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,036,688,169	1,136,448,708
剰余金減少額又は欠損金増加額	625,625,153	641,770,871
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	625,625,153	641,770,871
分配金	※ 2 -	※ 2 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,177,122,520	8,064,388,933

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2026年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を2026年1月13日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1. ※1 期首元本額	4,590,954,586円	4,882,340,404円
期中追加設定元本額	841,548,697円	853,297,431円
期中一部解約元本額	550,162,879円	506,395,380円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,882,340,404口	5,229,242,455口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第19期 自2024年1月11日 至2025年1月10日	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	13,078,577円	14,704,214円

2. ※2 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (140,069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 (574,030,997円)、投資信託約 款に規定される収益調整金 (4,116,557,854円)及び分配準 備積立金(1,610,522,016円)より 分配対象額は6,301,250,936円 (1万口当たり12,906.21円)で あり、分配を行っております。	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 (638,726円)、解約に伴う当期 純利益金額分配後の有価証券売 買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額 (1,391,949,850円)、投資信託 約款に規定される収益調整金 (4,770,372,588円)及び分配準 備積立金(1,978,595,116円)より 分配対象額は8,141,556,280円 (1万口当たり15,569.28円)で あり、分配を行っておりませ ん。
----------------	--	--

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	第20期
	2026年1月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	658,117,974	1,479,561,871
合計	658,117,974	1,479,561,871

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2652円 (22,652円)	2.5422円 (25,422円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	802,762,700	3,302,806,576	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	2,872,457,194	3,196,183,119	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	380,334,865	1,997,861,012	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	158,663,773	1,374,567,731	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	124,639,320	1,066,551,125	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	55,588,182	230,040,573	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	5,600,790	36,974,175	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	454,064,488	1,972,683,168	
親投資信託受益証券 合計			13,177,667,479	
合計			13,177,667,479	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,967,490,317	2,389,325,594
コール・ローン	904,283,103	1,063,289,225
国債証券	328,879,415,695	391,983,438,624
派生商品評価勘定	2,231,544	5,869,108
未収入金	399,798	163,177
未収利息	2,845,198,677	3,642,231,144
前払費用	173,731,044	252,679,001
流動資産合計	334,772,750,178	399,336,995,873
資産合計	334,772,750,178	399,336,995,873
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	742,790	30,297
未払金	30,295	107,103
未払解約金	241,628,673	279,820,426
流動負債合計	242,401,758	279,957,826
負債合計	242,401,758	279,957,826
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	89,835,036,001	96,991,845,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	244,695,312,419	302,065,192,642
元本等合計	334,530,348,420	399,057,038,047

純資産合計	334,530,348,420	399,057,038,047
負債純資産合計	334,772,750,178	399,336,995,873

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	82,950,829,216円	89,835,036,001円
期中追加設定元本額	16,497,885,839円	17,152,204,132円
期中一部解約元本額	9,613,679,054円	9,995,394,728円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	323,472,919円	247,483,866円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	4,752,496円	3,871,011円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	28,101,663円	18,863,785円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	13,996,359円	12,269,783円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	162,144,935円	128,297,751円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専 用)	865,372,677円	1,077,074,626円
外国債券インデックスファンド VA (適格機関投資家専用)	630,641,247円	708,188,680円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス エマージングプラ ス (為替ヘッジなし)	984,655,882円	1,060,633,314円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス (為替ヘッジな し)	6,307,226,578円	9,128,181,958円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス エ マージングプラス (為替ヘッジ なし)	1,139,339,402円	1,107,003,809円
D-I's 外国債券インデック ス	1,867,031円	1,452,629円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	21,959,219円	29,106,786円
iFree 外国債券インデック ス	1,370,819,261円	1,239,501,720円
iFree 8資産バランス	2,817,577,256円	3,438,591,744円
iFree 年金バランス	669,235,688円	787,718,055円

DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	2,739,372円	4,580,602円
DCダイワ外国債券インデック ス	51,536,593,982円	50,659,790,328円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,194,261,262円	1,222,177,963円
ダイワ・ライフ・バランス50	935,910,962円	1,012,538,922円
ダイワ・ライフ・バランス70	754,988,813円	853,214,274円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	738,830,429円	802,762,700円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	607,824,461円	667,024,269円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	290,966,699円	325,466,179円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	36,693,061円	35,461,186円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	22,713,452円	31,497,428円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	2,503,198,411円	2,976,322,320円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	5,049,300円	5,394,762円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,539,231円	3,210,532円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	18,184,160円	42,348,272円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ラップ専 用）	2,653,928,217円	3,456,995,521円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	84,268,985円	80,427,917円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	26,231,955円	24,716,995円
ダイワ・バランスファンド35 VA	2,368,483,230円	2,015,644,335円
ダイワ・バランスファンド25 VA（適格機関投資家専用）	150,332,450円	127,636,495円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	249,699円	375,943円
スタイル9（4資産分散・バラ ンス型）	2,838,995円	5,094,527円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	2,639,703円	5,889,867円

スタイル9（6資産分散・保守型）	54,282円	162,281円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,905,105円	4,819,562円
スタイル9（6資産分散・積極型）	671,101円	2,382,308円
スタイル9（8資産分散・保守型）	85,346円	244,554円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,866,086円	3,247,968円
スタイル9（8資産分散・積極型）	2,147,659円	3,650,262円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジなし）（投資一任専用）	2,705,214円	478,513,099円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	123,561,079円	104,084,268円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	68,402,011円	64,570,973円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワS MA専用）	4,235,139,772円	6,662,345,288円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	6,017,741,199円	6,224,328,545円
ダイワライフスタイル2 5	24,914,404円	21,788,090円
ダイワライフスタイル5 0	58,254,098円	57,320,458円
ダイワライフスタイル7 5	16,959,203円	17,576,895円
計	89,835,036,001円	96,991,845,405円
2. 期末日における受益権の総数	89,835,036,001口	96,991,845,405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2025年1月11日 至2026年1月13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	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△7,085,293,904	△2,077,106,474
合計	△7,085,293,904	△2,077,106,474

（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	2025年1月10日現在				2026年1月13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								
買建	644,092,775	-	645,581,529	1,488,754	1,073,272,617	-	1,079,111,428	5,838,811
アメリカ・ドル	167,479,255	-	168,239,011	759,756	177,256,608	-	177,398,513	141,905
イギリス・ ポンド	23,988,296	-	23,849,773	△138,523	28,938,243	-	28,937,685	△558
イスラエル・ シェケル	23,739,919	-	23,820,511	80,592	-	-	-	-
オーストラリ ア・ドル	27,454,623	-	27,435,125	△19,498	64,955,724	-	66,026,972	1,071,248
オフショア・ 人民元	200,086,066	-	200,497,659	411,593	180,562,847	-	182,225,942	1,663,095
カナダ・ドル	10,016,179	-	9,974,155	△42,024	30,228,399	-	30,302,374	73,975
シンガポー ル・ドル	-	-	-	-	42,997,659	-	43,421,859	424,200
スウェーデン ・クローナ	19,080,230	-	19,009,401	△70,829	17,510,813	-	17,790,111	279,298
デンマーク・ クローネ	9,146,800	-	9,063,184	△83,616	6,426,864	-	6,442,837	15,973
ニュージーラ ンド・ドル	63,607,440	-	63,945,725	338,285	-	-	-	-
ノルウェー・ クローネ	31,500,781	-	31,616,402	115,621	42,616,200	-	43,155,475	539,275
ポーランド・ ズロチ	58,916,539	-	59,129,711	213,172	130,058,649	-	130,799,768	741,119

メキシコ・ペソ	9,076,647	-	9,000,872	△75,775	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	351,720,611	-	352,609,892	889,281
合計	644,092,775	-	645,581,529	1,488,754	1,073,272,617	-	1,079,111,428	5,838,811

(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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	3.7238円	4.1143円
(1万口当たり純資産額)	(37,238円)	(41,143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	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	741,472.200	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	770,914.800	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	785,757.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,566,762.410	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,576,000.000	2,655,984.800	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	906,713.500	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	553,425.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	529,618.740	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	957,579.650	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,101,595.490	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,064,717.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,197,282.900	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,023,564.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,178,000.000	1,161,295.960	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,014,160.870	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,421,712.890	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,280,221.140	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,334,437.650	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,373,355.270	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,204,573.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,341,182.280	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,094,495.820	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,060,563.750	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,258,783.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,135,778.320	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,792,876.620	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,788,145.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,832,237.260	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,714,916.710	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,100,985.360	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,534,750.980	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,134,355.960	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,467,783.240	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,267,610.350	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,411,623.910	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,359,000.000	1,809,966.340	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	2,248,000.000	1,572,363.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,967,376.930	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,837,663.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	741,750.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,589,950.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,772,749.650	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,301,952.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,507,560.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,783,829.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,757,826.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,374,270.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,787,575.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,249,035.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,241,540.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,897,766.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,324,280.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,700,000.000	3,636,397.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,393,104.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,653,935.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,397,336.400	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,410,448.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,475,227.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	2,988,788.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,746,262.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	5,700,000.000	5,316,675.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,385,208.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,989,249.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,902,500.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,457,525.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,588,550.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,363,435.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,591,688.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	1,300,000.000	1,265,511.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,545,248.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,964,416.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,308,584.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,900,000.000	1,878,084.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,166,820.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,357,795.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,349,745.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,958,720.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,763,350.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,066,520.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,100,000.000	3,849,161.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,332,910.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,791,480.000	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,561,770.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,789,760.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,166,740.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	4,300,000.000	2,804,460.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,736,700.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,725,150.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,615,910.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,311,906.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,414,716.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,753,200.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,298,319.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,805,360.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	7,163,360.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	1,500,000.000	1,424,145.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,050,368.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,807,820.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,685,420.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,729,000.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,970,785.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,244,138.000	

1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,863,631.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,689,250.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,694,600.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,700,550.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,707,000.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,664,254.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,804,920.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,648,880.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,281,024.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	6,097,260.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,913,240.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	7,043,008.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	4,070,681.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	5,200,000.000	3,167,996.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,847,600.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,744,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,908,000.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,887,080.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,938,050.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,936,238.000	

2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,506,600.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,255,710.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,929,860.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,970,000.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,860,250.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,975,300.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,948,960.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,987,850.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	4,021,811.200	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,850,770.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,738,280.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,697,020.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,245,995.200	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,483,675.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,436,195.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,517,575.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,533,495.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,029,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	10,200,000.000	10,305,366.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,220,295.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,033,960.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,517,075.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,017,790.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,300,625.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	5,033,850.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,509,390.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	3,000,000.000	2,978,310.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,766,960.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,258,975.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,656,160.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,696,596.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	7,500,000.000	7,583,925.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,027,180.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,794,006.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,705,698.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,974,440.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,997,340.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,300,000.000	6,053,229.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,545,296.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,252,775.000	

3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,705,032.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,501,545.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	3,003,150.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,536,225.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,547,005.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	9,000,000.000	8,919,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,440,300.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,205,838.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	3,033,750.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,149,383.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,058,860.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,556,415.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,312,182.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,202,800.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,315,200.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,309,246.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,251,156.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,220,659.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,081,660.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,084,200.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	5,000,000.000	5,051,150.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,496,625.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,594,945.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	1,004,250.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	7,000,000.000	7,032,200.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	10,163,280.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,024,360.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	5,500,000.000	4,989,710.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,914,320.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,677,976.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,296,772.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,039,800.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,075,250.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,031,520.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,057,600.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,681,390.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,049,040.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,576,550.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,663,088.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	5,200,000.000	5,022,628.000	

4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,450,370.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,752,208.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,390,873.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,567,050.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,553,800.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	101,957.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,226,796.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,395,118.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	5,075,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,334,205.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	7,022,400.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,807,630.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,982,800.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,658,808.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,992,850.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	4,000,000.000	3,988,880.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	6,800,000.000	6,759,744.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,274,125.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	4,610,000.000	4,635,539.400	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,077,700.000	

4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	10,000,000.000	10,100,900.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,242,798.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,771,515.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	4,300,000.000	4,360,114.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,586,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,360,328.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,547,985.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	4,033,800.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,100,360.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,617,145.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	1,500,000.000	1,509,690.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,040,170.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,633,900.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	10,800,000.000	11,203,272.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,576,890.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,410,104.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,494,785.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131	6,500,000.000	6,537,440.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,105,680.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	4,051,000.000	

4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	4,000,000.000	4,024,840.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	3,020,310.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	5,019,100.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,544,065.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	7,077,910.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	3,012,120.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	2,500,000.000	2,506,425.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,518,935.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	6,800,000.000	6,704,868.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	9,500,000.000	9,574,955.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	4,016,920.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	4,500,000.000	4,528,350.000	
5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515	1,200,000.000	1,236,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	5,800,000.000	5,825,114.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531	3,500,000.000	3,542,105.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	5,800,000.000	5,865,134.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615	2,000,000.000	2,014,520.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	5,800,000.000	5,817,168.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320630	3,300,000.000	3,315,444.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,200,000.000	3,219,232.000	

3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715	2,000,000.000	2,014,440.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	6,000,000.000	6,035,820.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815	7,500,000.000	7,550,325.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280815	6,000,000.000	6,007,500.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	8,000,000.000	8,039,680.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815	5,600,000.000	5,523,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731	4,600,000.000	4,619,136.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320831	3,300,000.000	3,288,252.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450815	2,500,000.000	2,532,600.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	3,500,000.000	3,504,095.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	5,500,000.000	5,472,280.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280915	3,000,000.000	2,984,340.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	5,500,000.000	5,471,180.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	4,500,000.000	4,496,625.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320930	3,000,000.000	2,987,670.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281015	8,000,000.000	7,981,520.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	4,500,000.000	4,475,025.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	8,800,000.000	8,792,872.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20351115	6,200,000.000	6,107,434.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281115	4,500,000.000	4,488,570.000	

	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20551115	3,700,000.000	3,576,272.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321031	4,000,000.000	3,951,840.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20451115	2,200,000.000	2,156,154.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	5,500,000.000	5,437,245.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	6,000,000.000	5,981,700.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321130	3,500,000.000	3,456,250.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281215	4,500,000.000	4,487,850.000	
アメリカ・ドル 小計			1,139,889,745.250 (180,421,748,878)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,482,000.000	842,857.860	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	945,014.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,085,136.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	867,569.200	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,521,103.400	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,422,975.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	724,814.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	668,404.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	766,912.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,600,000.000	2,345,876.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,332,396.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,600,000.000	2,219,672.000	

0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,000,000.000	804,120.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,057,770.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,900,000.000	719,948.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	4,200,000.000	2,984,352.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	2,055,775.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,050,000.000	982,688.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	2,200,000.000	996,600.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	2,037,227.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,458,080.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,445,187.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	610,428.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,448,674.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	401,624.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,009,000.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,300,000.000	1,193,712.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,459,704.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,984,000.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,100,000.000	901,010.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	3,400,000.000	3,462,662.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,382,005.000	

4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,460,250.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	2,300,000.000	2,302,622.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,980,000.000	1,762,576.200	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,600,000.000	2,600,832.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,800,000.000	2,832,592.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	3,100,000.000	3,087,228.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,550,000.000	2,449,198.500	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	2,000,000.000	2,028,360.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	3,000,000.000	3,060,570.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,800,000.000	1,816,956.000	
5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	365,463.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20351022	1,900,000.000	1,946,341.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20290522	800,000.000	805,496.000	
5.25% UNITED KINGDOM GILT 20410131	1,100,000.000	1,149,247.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20310307	500,000.000	503,925.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20330307	1,100,000.000	1,097,998.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,009,527.220	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,440,000.000	1,461,225.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,262,000.000	2,223,070.980	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,772,408.890	

	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,488,607.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,227,610.540	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	2,332,000.000	2,361,802.960	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,018,452.400	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,396,577.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,143,000.000	1,014,161.040	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	846,000.000	806,271.840	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,760,000.000	1,786,206.400	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	972,306.800	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,484,587.800	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,251,051.680	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,960,050.780	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,018,294.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,408,249.400	
イギリス・ポンド 小計			110,067,414.390 (23,466,372,748)	
イスラエル・ シェケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,700,000.000	3,157,758.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,766,718.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,255,064.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,160,484.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,164,896.000	

	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,400,000.000	2,659,344.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	3,400,000.000	2,958,510.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	2,280,000.000	1,730,246.400	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,823,066.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	2,700,000.000	2,746,737.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,508,200.000	
	4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,656,336.000	
	4.1% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20280731	1,400,000.000	1,418,998.000	
	4.15% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20351031	600,000.000	615,996.000	
イスラエル・シュケル 小計			30,622,353.400 (1,540,690,218)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,008,054.620	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,319,026.180	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,262,290.200	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,463,000.000	1,334,065.810	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,207,000.000	1,886,190.480	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	665,747.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,634,881.600	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,728,000.000	1,659,674.880	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	906,973.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,447,305.000	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,807,014.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,680,608.700	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,061,445.700	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,460,121.600	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,234,169.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,714,960.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	2,000,000.000	1,025,920.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,073,475.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	2,600,000.000	2,190,266.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,529,167.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,886,080.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	2,300,000.000	2,111,377.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	838,800.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,074,865.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,641,979.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	2,500,000.000	2,409,550.000	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021	1,400,000.000	1,343,510.000	
オーストラリア・ドル 小計			45,207,517.890 (4,800,586,325)	
オフショア・人 民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,275,300.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,325,950.000	

3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,615,000.000	
2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,282,750.000	
2.68% China Government Bond 20300521	29,500,000.000	30,827,500.000	
3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	30,124,330.000	
3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,579,375.000	
3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	20,604,993.000	
3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	28,050,030.000	
3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	21,316,640.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,006,014.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,716,260.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,301,500.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,771,800.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	14,000,000.000	18,166,960.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	11,800,000.000	14,939,036.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	27,179,790.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,151,000.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,069,560.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,119,040.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,186,660.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,126,896.000	

2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,633,000.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,216,900.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,504,080.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,314,200.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	19,000,000.000	19,811,490.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,089,460.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	33,736,960.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,880,000.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,504,956.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	22,329,060.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	29,500,000.000	31,554,380.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,923,780.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,504,200.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,169,550.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,785,550.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,693,750.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	25,194,568.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,190,300.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,488,960.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,857,150.000	

2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	28,000,000.000	29,460,480.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,719,500.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,387,800.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	26,000,000.000	29,341,520.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,623,400.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,314,800.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,225,000.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,603,700.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,289,800.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	16,000,000.000	16,632,800.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,087,100.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,322,030.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,588,200.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,708,750.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	20,000,000.000	20,459,200.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,369,880.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,202,050.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	44,979,880.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,307,560.000	
1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	21,000,000.000	21,159,390.000	

1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	34,000,000.000	34,041,140.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	19,000,000.000	19,295,830.000	
1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	19,100,000.000	18,857,812.000	
1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	45,000,000.000	44,761,050.000	
1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	3,635,920.000	
1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	42,000,000.000	41,161,680.000	
1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	34,000,000.000	34,049,640.000	
1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315	10,000,000.000	10,029,000.000	
1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	52,000,000.000	52,228,280.000	
1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	17,000,000.000	16,715,080.000	
1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	30,059,100.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	37,000,000.000	36,492,360.000	
1.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20270615	20,000,000.000	20,013,200.000	
1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	8,000,000.000	7,983,360.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	10,000,000.000	9,991,800.000	
1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	39,000,000.000	38,835,810.000	
1.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20270915	31,000,000.000	31,016,120.000	
1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20320915	13,000,000.000	13,022,490.000	
1.63% CHINA GOVERNMENT BOND 20301025	12,000,000.000	11,997,480.000	
1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20351115	10,000,000.000	9,926,500.000	

オフショア・人民元 小計			2,031,015,170.000 (46,107,903,288)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	855,000.000	668,379.150	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,514,315.850	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,302,444.340	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,156,756.480	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	953,272.430	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	931,852.870	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,125,553.450	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,215,162.800	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	640,731.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,597,037.100	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,199,613.800	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,216,366.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,800,000.000	2,488,472.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,144,354.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,706,096.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,171,026.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,472,606.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,402,965.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	600,000.000	587,568.000	

2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,203,924.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,177,315.900	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,323,712.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,650,377.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,780,000.000	1,436,477.800	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,217,196.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,000,990.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,867,140.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,665,762.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,525,965.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	818,768.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,586,922.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,990,360.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	1,700,000.000	1,710,523.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	2,600,000.000	2,577,978.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	1,250,000.000	1,172,425.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501	3,200,000.000	3,211,328.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	2,400,000.000	2,380,896.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	499,810.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201	3,500,000.000	3,457,265.000	

	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101	900,000.000	899,010.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310301	200,000.000	197,708.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,000,000.000	995,170.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,800,000.000	1,787,364.000	
カナダ・ドル 小計			69,848,959.470 (7,964,876,848)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	789,601.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	847,176.710	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	430,996.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	621,954.320	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	649,556.250	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	897,844.980	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	756,510.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	563,469.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	662,675.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	508,944.600	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	591,774.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	471,500.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	249,717.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	920,000.000	1,105,380.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	511,595.000	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	412,996.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	625,074.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	329,847.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	121,127.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	242,877.700	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	164,558.400	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701	90,000.000	91,057.500	
シンガポール・ドル 小計			11,646,233.160 (1,433,185,453)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	3,865,637.650	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,896,682.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,250,104.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,052,224.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,435,700.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,755,880.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	6,700,000.000	6,413,173.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20361015	5,000,000.000	4,833,550.000	
スウェーデン・クローナ 小計			37,502,950.650 (647,675,958)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,122,116.340	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,978,059.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,848,649.100	

	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,698,900.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,900,000.000	2,533,991.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,959,620.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20351115	500,000.000	479,890.000	
デンマーク・クローネ 小計			31,621,225.440 (781,044,268)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	613,122.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,446,195.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	414,123.500	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,087,955.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	1,330,000.000	1,182,463.100	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,182.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	1,030,689.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	837,267.400	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	255,930.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	501,970.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,139,677.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	693,070.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	1,500,000.000	1,522,695.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,283,581.000	
ニュージーランド・ドル 小計			12,243,920.500 (1,119,339,213)	

ノルウェー・クロネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,346,270.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,356,675.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,570,721.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,295,664.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,024,875.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	3,200,000.000	2,870,752.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,480,560.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,730,600.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,388,910.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,890,820.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	3,900,000.000	3,785,106.000	
ノルウェー・クロネ 小計			35,740,953.500 (562,205,199)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,123,749.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,604,679.200	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,800,000.000	5,031,732.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	4,223,400.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,700,000.000	3,714,393.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,440,950.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,361,650.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	7,000,000.000	7,145,950.000	

	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,497,570.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	4,000,000.000	4,108,080.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	967,250.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	2,900,000.000	2,914,007.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	100,000.000	92,982.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	3,600,000.000	3,574,368.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20310125	2,000,000.000	1,998,940.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	869,168.730	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,575,978.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		61,244,847.630 (2,683,700,227)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,392,933.200	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,541,191.180	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,880,730.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	739,399.190	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,461,533.400	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,915,685.640	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,477,307.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,288,539.600	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,037,619.600	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,211,586.600	

	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,145,078.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,372,436.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,230,300.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,366,641.200	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,373,916.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,047,020.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,540,616.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,685,483.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,738,242.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,413,930.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,094,997.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	521,125.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,369,928.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,326,381.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,235,880.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,563,600.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,002,820.000	
	3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702	2,050,000.000	2,042,763.500	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	830,000.000	821,675.100	
	マレーシア・リングット 小計		51,839,357.710 (2,020,102,011)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,619,821.000	

	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	14,000,000.000	13,724,900.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	32,066,050.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	28,156,800.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,705,850.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	45,000,000.000	45,557,550.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,154,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	10,000,000.000	10,079,900.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	4,000,000.000	3,745,120.000	
	8% MEXICAN BONOS 20320415	5,000,000.000	4,847,700.000	
	8% MEXICAN BONOS 20550429	1,000,000.000	862,480.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,020,020.480	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,534,935.520	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,889,960.240	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,961,392.160	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	43,193,349.650	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	42,654,000.000	36,931,112.820	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	33,692,108.400	
メキシコ・ペソ 小計			371,743,850.270 (3,282,200,802)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	330,675.800	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	236,901.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	779,088.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	407,085.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	477,465.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	467,015.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	510,000.000	374,018.700	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	251,948.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	444,260.000	

0.125% Finland Government Bond 20520415	520,000.000	206,622.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	520,194.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	271,300.500	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	737,480.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	267,813.000	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	376,372.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	600,000.000	603,600.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,016,620.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	337,940.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	600,000.000	599,538.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	500,345.000	
3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	328,436.500	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	500,000.000	495,425.000	
2.625% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320415	100,000.000	99,246.000	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	536,052.160	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	113,383.200	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,256,064.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	315,597.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,165,956.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,211,840.000	

Austria Government Bond 20300220	980,000.000	886,998.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	623,556.000	
Austria Government Bond 20401020	700,000.000	422,198.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	226,702.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,052,124.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	440,724.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	104,985.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,693,026.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,347,450.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	714,640.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,306,383.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	446,350.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	203,704.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	831,872.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	498,465.000	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	490,600.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	802,552.000	
2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	1,100,000.000	1,091,255.000	
2.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320920	300,000.000	300,423.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,621,418.260	

1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	631,171.440	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	807,617.240	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	439,167.800	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,080,794.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	880,000.000	571,806.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	485,700.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,440,070.100	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,202,377.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,426,785.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	438,305.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	420,000.000	377,084.400	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	541,430.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,156,344.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,366,736.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	158,904.600	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,195,264.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	435,336.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	726,936.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,500,345.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	507,624.000	

3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	659,113.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,400,000.000	1,364,468.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	871,930.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	800,000.000	806,424.000	
3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	800,000.000	788,904.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	663,747.000	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	548,977.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,241,582.970	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,308,237.680	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,009,660.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,241,113.700	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,483,041.040	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,705,000.000	1,968,627.100	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,971,000.000	2,170,760.850	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,074,617.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,065,253.790	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	1,478,702.060	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,414,073.680	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	3,079,000.000	2,698,959.030	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,158,750.000	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,220,833.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,306,821.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,839,485.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,908,940.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,430,784.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,770,050.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,150,000.000	1,370,124.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,594,232.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,800,000.000	2,161,124.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,927,100.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	3,500,000.000	3,147,165.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,900,000.000	1,709,012.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,684,103.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	3,400,000.000	2,531,334.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,883,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	743,784.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,397,936.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	873,660.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,100,000.000	2,667,054.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,267,280.000	

1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,563,623.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	1,885,581.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,177,408.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	4,200,000.000	4,117,890.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	980,970.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	712,900.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,391,576.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,800,000.000	1,799,604.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,314,560.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,100,000.000	1,747,410.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,600,000.000	1,486,480.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,465,070.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,900,000.000	1,860,157.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	1,850,000.000	1,663,372.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	784,216.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815	1,600,000.000	1,573,120.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20321115	50,000.000	49,705.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,400,000.000	975,816.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311	2,000,000.000	2,003,660.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,502.000	

1.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270916	1,400,000.000	1,395,982.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271216	700,000.000	698,740.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,600,000.000	2,535,520.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,961,990.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	424,629.300	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,001,930.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	1,100,000.000	1,106,655.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	99,578.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,095,479.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	1,010,000.000	1,017,393.200	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	500,000.000	501,035.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301010	1,400,000.000	1,387,624.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,636,724.430	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,406,062.090	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	2,938,301.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	2,772,051.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,432,329.180	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,370,482.640	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,577,751.300	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,147,389.510	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,466,459.960	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,055,664.080	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,784,435.200	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,669,000.000	4,542,116.180	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,587,000.000	792,373.230	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	3,170,000.000	2,490,478.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,348,524.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,732,444.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,209,542.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	6,350,000.000	5,401,881.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,727,893.500	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	3,250,000.000	1,888,315.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,550,000.000	4,262,076.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,807,972.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,221,902.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	3,100,000.000	1,950,582.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,600,000.000	4,907,392.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,180,000.000	299,000.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	2,400,000.000	1,295,112.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	5,200,000.000	4,391,764.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	3,907,480.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,110,798.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	4,200,000.000	3,477,936.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,261,850.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,167,474.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,827,883.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	2,300,000.000	1,858,216.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,627,647.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,551,010.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	5,300,000.000	5,348,601.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,257,664.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	570,857.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,116,089.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,800,000.000	1,458,324.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	5,400,000.000	5,425,920.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	3,700,000.000	3,595,179.000	
3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,200,000.000	1,140,444.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	1,100,000.000	973,907.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	3,500,000.000	3,433,990.000	
2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	3,500,000.000	3,503,080.000	

2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	3,200,000.000	3,184,768.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20351125	1,800,000.000	1,799,208.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,214,025.930	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,912,950.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,822,798.250	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,450,692.280	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,688,807.620	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,600,000.000	1,570,096.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,303,938.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,117,644.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	832,668.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,255,548.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	1,300,000.000	1,274,624.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,630,000.000	662,741.700	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,500,000.000	1,305,150.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	618,822.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	841,725.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	872,460.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,097,280.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	885,051.000	

2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,305,382.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	590,676.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,350,000.000	1,316,655.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	1,800,000.000	1,738,854.000	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20560115	450,000.000	447,255.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,572,763.440	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,341,395.370	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,920,160.900	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,301,057.100	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,075,703.840	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	701,509.600	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,432,650.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,512,551.900	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,497,061.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,697,300.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,209,143.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,091,600.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,582,538.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,480,942.100	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,393,247.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,951,823.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,160,587.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,806,843.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,322,481.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,145,419.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,800,000.000	1,495,764.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,855,140.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,998,570.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,157,650.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,150,470.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,366,260.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	737,244.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	1,200,000.000	916,128.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,820,979.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,595,718.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	732,512.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	1,160,000.000	701,452.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,200,387.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,703,179.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,035,063.000	

0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,450,214.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	540,952.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	296,469.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	1,800,000.000	1,819,566.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,548,976.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,216,142.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	1,008,250.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,584,315.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,800,000.000	1,953,720.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,247,312.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,536,585.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,695,760.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,248,780.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	955,701.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,251,912.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,271,906.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	725,445.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,248,554.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,586,250.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	629,370.000	

2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	201,758.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,034,620.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,084,640.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	1,400,000.000	1,439,340.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	1,600,000.000	1,670,720.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,205.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,237,776.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,528,380.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,700,000.000	1,770,363.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	800,000.000	812,872.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	1,005,930.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,318,551.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	806,744.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,000,000.000	1,022,100.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	500,000.000	504,820.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	1,200,000.000	1,203,348.000	
2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225	800,000.000	803,640.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	500,000.000	506,020.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	500,000.000	503,850.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	1,700,000.000	1,726,384.000	

3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	600,000.000	609,972.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001	1,500,000.000	1,499,385.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270826	700,000.000	699,097.000	
2.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	299,307.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321115	1,600,000.000	1,620,288.000	
4.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20551001	400,000.000	423,332.000	
2.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310201	1,550,000.000	1,556,045.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360201	700,000.000	700,833.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,554,000.000	1,707,706.140	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,301,649.120	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,111,759.750	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,598,371.580	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,868,286.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,755,914.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,550,044.270	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,557,781.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,313,000.000	1,447,635.020	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,401,772.520	

5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,146,560.420	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,169,550.880	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,586,283.840	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	832,104.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	623,619.980	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	740,471.220	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	959,356.690	
2% IRISH TREASURY 20450218	1,081,000.000	856,130.380	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	473,462.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	777,552.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	677,317.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	708,900.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	913,738.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	395,574.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,758.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	488,140.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	718,528.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	689,504.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	264,888.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,443.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	187,786.000	

2.6% IRISH TREASURY 20341018	500,000.000	486,485.000	
3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	286,137.600	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	875,432.250	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,494,647.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	338,402.220	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	681,261.210	
2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,315,570.470	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	394,477.120	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	360,052.550	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,939,503.320	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,001,767.040	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,752,000.000	1,516,601.280	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,083,187.500	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,886,434.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,679,282.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,027,552.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,360,040.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,807,542.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,841,681.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,555,488.000	

1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,950,000.000	3,520,042.500	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,550,834.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,354,022.400	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,700,000.000	916,334.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,600,000.000	2,550,236.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,257,440.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	2,100,000.000	1,519,980.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,926,694.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	950,000.000	438,501.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,394,825.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	529,879.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	2,200,000.000	1,941,742.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	399,906.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	2,200,000.000	2,153,404.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,849,596.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,053,664.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,100,000.000	2,932,011.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	2,100,000.000	2,060,184.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,244,659.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,636,348.000	

3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,173,752.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,556,175.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,400,000.000	1,450,330.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,632,552.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,080.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,200,000.000	1,186,908.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	2,600,000.000	2,663,700.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,800,000.000	1,836,252.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	201,564.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,197,084.000	
2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	1,700,000.000	1,707,123.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	500,000.000	489,605.000	
3.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031	1,500,000.000	1,496,280.000	
3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330131	900,000.000	904,725.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,559,388.030	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,889,706.980	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,124,715.900	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,210,805.690	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,906,821.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	2,008,931.580	

4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	918,637.500	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	697,768.400	
3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	667,472.400	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,300,871.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	570,000.000	601,429.800	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	684,028.800	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	991,330.000	
0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	821,844.000	
0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	606,050.000	
0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	612,097.500	
1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	338,650.200	
0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	658,980.000	
1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	363,916.800	
1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	534,061.500	
3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	506,025.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	624,015.000	
3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	440,000.000	417,542.400	
3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	300,000.000	298,020.000	
3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	294,681.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20331014	100,000.000	99,866.000	

	ユーロ 小計		623,824,731.500 (115,151,807,188)	
国債証券	合計		391,983,438,624 [391,983,438,624]	
合計			391,983,438,624 [391,983,438,624]	

（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 289銘柄	100%	46.0%
イギリス・ポンド	国債証券 66銘柄	100%	6.0%
イスラエル・シェケル	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 82銘柄	100%	11.8%
カナダ・ドル	国債証券 43銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 22銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 14銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 11銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 17銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券 29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 18銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 408銘柄	100%	29.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	266,305,137	308,603,441
国債証券	86,229,924,420	100,368,650,670
地方債証券	4,895,279,143	4,956,690,541
特殊債券	4,295,518,601	4,344,040,926
社債券	7,055,764,900	6,995,893,100
未収利息	140,851,071	221,506,910
前払費用	10,364,348	29,825,067
流動資産合計	102,894,007,620	117,225,210,655
資産合計	102,894,007,620	117,225,210,655
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,000,000
未払解約金	4,951,467	23,947,575
流動負債合計	4,951,467	123,947,575
負債合計	4,951,467	123,947,575
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	86,883,319,456	105,238,578,046
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,005,736,697	11,862,685,034
元本等合計	102,889,056,153	117,101,263,080
純資産合計	102,889,056,153	117,101,263,080
負債純資産合計	102,894,007,620	117,225,210,655

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	43,756,341,643円	86,883,319,456円
期中追加設定元本額	44,822,634,752円	20,460,208,861円
期中一部解約元本額	1,695,656,939円	2,104,950,271円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド （F0Fs用）（適格機関投資家専用）	4,380,047,718円	6,118,572,648円
日本債券インデックスファンド VA（適格機関投資家専用）	32,907,482,926円	38,661,180,466円
i F r e e 日本債券インデックス	2,660,550,588円	2,278,913,313円
i F r e e 8資産バランス	8,762,844,955円	12,360,612,313円
ダイワ・ライフ・バランス30	13,529,680,744円	15,485,770,676円
ダイワ・ライフ・バランス50	11,596,861,637円	13,791,379,502円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,717,038,134円	6,066,311,938円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	2,301,913,880円	2,872,457,194円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	1,889,567,399円	2,347,278,015円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	904,445,150円	1,148,627,419円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,787,929,322円	3,417,898,748円
ダイワつみたてインデックス バランス30	58,275,036円	71,542,666円

ダイワつみたてインデックスバ ランス５０	32,015,092円	46,680,305円
ダイワつみたてインデックスバ ランス７０	114,896,806円	308,279,025円
ダイワ世界バランスファンド４ ０ＶＡ	190,074,965円	209,096,195円
ダイワ世界バランスファンド６ ０ＶＡ	49,695,104円	53,977,623円
計	86,883,319,456円	105,238,578,046円
2. 期末日における受益権の総数	86,883,319,456口	105,238,578,046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2025年1月11日 至2026年1月13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	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△579,593,360	△1,654,112,190
地方債証券	△26,280,719	△59,424,088
特殊債券	△22,395,992	△68,910,713
社債券	△21,227,000	△46,614,500
合計	△649,497,071	△1,829,061,491

（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

2025年1月10日現在	2026年1月13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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.1842円	1.1127円
(1万口当たり純資産額)	(11,842円)	(11,127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	469 2年国債	250,000,000	249,452,500	
	470 2年国債	575,000,000	574,258,250	
	471 2年国債	100,000,000	99,940,000	
	472 2年国債	60,000,000	59,781,600	

473 2年国債	700,000,000	697,949,000	
474 2年国債	500,000,000	497,590,000	
475 2年国債	380,000,000	379,103,200	
477 2年国債	50,000,000	49,915,500	
478 2年国債	800,000,000	798,376,000	
479 2年国債	200,000,000	199,520,000	
151 5年国債	600,000,000	593,496,000	
152 5年国債	340,000,000	336,691,800	
153 5年国債	1,520,000,000	1,498,142,400	
154 5年国債	1,900,000,000	1,868,916,000	
155 5年国債	340,000,000	334,631,400	
156 5年国債	1,870,000,000	1,836,938,400	
157 5年国債	100,000,000	97,929,000	
158 5年国債	2,350,000,000	2,296,326,000	
159 5年国債	200,000,000	194,736,000	
161 5年国債	1,300,000,000	1,271,920,000	
162 5年国債	380,000,000	370,579,800	
163 5年国債	1,900,000,000	1,857,839,000	
164 5年国債	1,200,000,000	1,162,068,000	
165 5年国債	200,000,000	194,242,000	
166 5年国債	620,000,000	603,898,600	
167 5年国債	70,000,000	67,921,700	
168 5年国債	700,000,000	683,578,000	
169 5年国債	800,000,000	778,800,000	
170 5年国債	300,000,000	291,951,000	
171 5年国債	650,000,000	628,205,500	
173 5年国債	680,000,000	659,328,000	
174 5年国債	1,000,000,000	973,100,000	
175 5年国債	50,000,000	48,868,000	
176 5年国債	945,000,000	927,281,250	
177 5年国債	400,000,000	393,984,000	
178 5年国債	1,375,000,000	1,345,588,750	
179 5年国債	500,000,000	487,990,000	
180 5年国債	475,000,000	465,652,000	
181 5年国債	1,100,000,000	1,085,381,000	
1 40年国債	700,000,000	609,945,000	
2 40年国債	200,000,000	165,142,000	
3 40年国債	400,000,000	324,048,000	
4 40年国債	550,000,000	435,924,500	

5 40年国債	61,000,000	45,456,590	
6 40年国債	268,000,000	193,077,920	
7 40年国債	190,000,000	130,296,300	
8 40年国債	100,000,000	62,632,000	
9 40年国債	240,000,000	104,503,200	
10 40年国債	290,000,000	150,730,400	
11 40年国債	240,000,000	118,149,600	
12 40年国債	200,000,000	84,940,000	
13 40年国債	450,000,000	187,641,000	
14 40年国債	350,000,000	155,134,000	
15 40年国債	650,000,000	317,577,000	
16 40年国債	700,000,000	373,380,000	
17 40年国債	480,000,000	337,982,400	
18 40年国債	750,000,000	666,300,000	
3 CT5年国債	150,000,000	146,397,000	
1 CT10年国債	130,000,000	117,946,400	
346 10年国債	20,000,000	19,805,400	
347 10年国債	500,000,000	493,480,000	
348 10年国債	1,000,000,000	983,640,000	
349 10年国債	430,000,000	421,584,900	
350 10年国債	400,000,000	390,864,000	
351 10年国債	500,000,000	486,840,000	
352 10年国債	150,000,000	145,503,000	
353 10年国債	520,000,000	502,091,200	
355 10年国債	200,000,000	191,302,000	
356 10年国債	600,000,000	571,182,000	
357 10年国債	600,000,000	568,176,000	
358 10年国債	1,280,000,000	1,206,220,800	
359 10年国債	1,060,000,000	993,803,000	
360 10年国債	1,620,000,000	1,511,508,600	
361 10年国債	1,100,000,000	1,021,537,000	
362 10年国債	1,530,000,000	1,414,163,700	
363 10年国債	880,000,000	809,195,200	
364 10年国債	1,120,000,000	1,024,217,600	
365 10年国債	1,400,000,000	1,273,118,000	
366 10年国債	1,140,000,000	1,037,434,200	
367 10年国債	1,350,000,000	1,221,642,000	
368 10年国債	1,150,000,000	1,035,000,000	
369 10年国債	1,550,000,000	1,417,521,500	

370 10年国債	1,370,000,000	1,246,480,800	
371 10年国債	1,350,000,000	1,212,232,500	
372 10年国債	1,280,000,000	1,179,276,800	
373 10年国債	1,440,000,000	1,299,312,000	
374 10年国債	1,170,000,000	1,067,566,500	
375 10年国債	540,000,000	502,583,400	
376 10年国債	1,350,000,000	1,229,674,500	
377 10年国債	1,250,000,000	1,163,637,500	
378 10年国債	1,075,000,000	1,014,359,250	
379 10年国債	750,000,000	711,495,000	
380 10年国債	1,100,000,000	1,059,047,000	
2 30年国債	9,000,000	9,314,730	
3 30年国債	4,000,000	4,125,480	
4 30年国債	80,000,000	84,813,600	
5 30年国債	8,000,000	8,226,160	
6 30年国債	9,000,000	9,347,580	
7 30年国債	100,000,000	103,229,000	
10 30年国債	25,000,000	23,751,500	
11 30年国債	9,000,000	8,888,580	
12 30年国債	100,000,000	101,374,000	
13 30年国債	11,000,000	11,052,910	
14 30年国債	22,000,000	22,722,260	
15 30年国債	21,000,000	21,812,490	
16 30年国債	26,000,000	26,981,500	
17 30年国債	75,000,000	77,127,000	
18 30年国債	20,000,000	20,362,600	
19 30年国債	15,000,000	15,248,100	
20 30年国債	16,000,000	16,521,600	
21 30年国債	16,000,000	16,209,600	
22 30年国債	17,000,000	17,489,430	
23 30年国債	16,000,000	16,428,000	
24 30年国債	15,000,000	15,369,150	
25 30年国債	17,000,000	17,052,020	
26 30年国債	32,000,000	32,341,760	
27 30年国債	120,000,000	121,760,400	
28 30年国債	800,000,000	807,536,000	
29 30年国債	43,000,000	42,688,680	
30 30年国債	56,000,000	54,565,280	
31 30年国債	76,000,000	72,602,040	

32 30年国債	115,000,000	110,452,900	
33 30年国債	95,000,000	87,182,450	
34 30年国債	150,000,000	140,115,000	
35 30年国債	120,000,000	108,182,400	
36 30年国債	138,000,000	123,372,000	
37 30年国債	165,000,000	144,178,650	
38 30年国債	350,000,000	298,494,000	
39 30年国債	105,000,000	90,536,250	
40 30年国債	80,000,000	67,542,400	
41 30年国債	130,000,000	107,536,000	
42 30年国債	200,000,000	164,482,000	
43 30年国債	335,000,000	274,043,400	
44 30年国債	155,000,000	126,264,550	
45 30年国債	200,000,000	156,412,000	
46 30年国債	250,000,000	194,520,000	
47 30年国債	355,000,000	280,066,600	
48 30年国債	300,000,000	226,710,000	
49 30年国債	340,000,000	255,418,200	
50 30年国債	320,000,000	210,598,400	
51 30年国債	400,000,000	231,396,000	
52 30年国債	350,000,000	211,106,000	
53 30年国債	350,000,000	214,669,000	
54 30年国債	320,000,000	204,467,200	
55 30年国債	350,000,000	221,914,000	
56 30年国債	360,000,000	226,494,000	
57 30年国債	315,000,000	196,660,800	
59 30年国債	290,000,000	173,472,200	
60 30年国債	270,000,000	168,752,700	
61 30年国債	100,000,000	58,841,000	
62 30年国債	250,000,000	137,800,000	
63 30年国債	320,000,000	169,494,400	
64 30年国債	340,000,000	178,343,600	
65 30年国債	300,000,000	155,757,000	
67 30年国債	340,000,000	183,661,200	
68 30年国債	350,000,000	187,096,000	
69 30年国債	350,000,000	190,925,000	
71 30年国債	340,000,000	181,818,400	
72 30年国債	250,000,000	132,785,000	
73 30年国債	340,000,000	179,166,400	

74 30年国債	510,000,000	292,989,900	
75 30年国債	360,000,000	224,175,600	
76 30年国債	340,000,000	216,671,800	
77 30年国債	320,000,000	214,313,600	
78 30年国債	310,000,000	196,350,900	
79 30年国債	330,000,000	197,033,100	
80 30年国債	320,000,000	224,131,200	
81 30年国債	350,000,000	232,438,500	
82 30年国債	390,000,000	272,368,200	
83 30年国債	350,000,000	269,237,500	
84 30年国債	280,000,000	210,201,600	
85 30年国債	340,000,000	267,321,600	
86 30年国債	410,000,000	329,890,100	
87 30年国債	200,000,000	175,630,000	
88 30年国債	260,000,000	247,382,200	
93 20年国債	18,000,000	18,224,280	
94 20年国債	45,000,000	45,613,350	
95 20年国債	30,000,000	30,543,300	
96 20年国債	63,000,000	63,963,270	
97 20年国債	25,000,000	25,464,500	
98 20年国債	64,000,000	65,083,520	
99 20年国債	53,000,000	53,981,560	
100 20年国債	35,000,000	35,777,000	
101 20年国債	18,000,000	18,476,100	
102 20年国債	10,000,000	10,285,700	
103 20年国債	21,000,000	21,550,410	
104 20年国債	64,000,000	65,367,680	
105 20年国債	38,000,000	38,858,040	
106 20年国債	16,000,000	16,402,880	
107 20年国債	40,000,000	40,914,800	
108 20年国債	68,000,000	69,161,440	
109 20年国債	60,000,000	61,014,600	
110 20年国債	27,000,000	27,621,270	
111 20年国債	35,000,000	35,927,850	
113 20年国債	170,000,000	173,952,500	
114 20年国債	45,000,000	46,036,350	
115 20年国債	42,000,000	43,123,500	
116 20年国債	27,000,000	27,726,570	
117 20年国債	77,000,000	78,769,460	

118 20年国債	13,000,000	13,242,450	
119 20年国債	23,000,000	23,233,450	
120 20年国債	98,000,000	98,161,700	
121 20年国債	100,000,000	101,372,000	
123 20年国債	42,000,000	42,969,360	
124 20年国債	600,000,000	610,968,000	
125 20年国債	225,000,000	231,342,750	
126 20年国債	21,000,000	21,386,190	
127 20年国債	110,000,000	111,470,700	
128 20年国債	32,000,000	32,406,720	
129 20年国債	95,000,000	95,709,650	
130 20年国債	110,000,000	110,684,200	
131 20年国債	150,000,000	150,115,500	
132 20年国債	25,000,000	24,979,750	
133 20年国債	150,000,000	150,726,000	
134 20年国債	500,000,000	501,670,000	
135 20年国債	20,000,000	19,949,800	
136 20年国債	180,000,000	178,493,400	
137 20年国債	18,000,000	17,922,060	
139 20年国債	250,000,000	247,402,500	
140 20年国債	100,000,000	99,403,000	
141 20年国債	140,000,000	138,922,000	
142 20年国債	210,000,000	209,739,600	
143 20年国債	100,000,000	98,353,000	
144 20年国債	130,000,000	126,995,700	
145 20年国債	40,000,000	39,504,800	
146 20年国債	160,000,000	157,643,200	
147 20年国債	400,000,000	390,248,000	
148 20年国債	290,000,000	279,905,100	
149 20年国債	110,000,000	105,765,000	
150 20年国債	480,000,000	456,163,200	
151 20年国債	290,000,000	269,963,900	
152 20年国債	670,000,000	620,969,400	
153 20年国債	600,000,000	558,912,000	
154 20年国債	80,000,000	73,555,200	
155 20年国債	630,000,000	565,380,900	
156 20年国債	630,000,000	528,009,300	
157 20年国債	670,000,000	545,219,200	
158 20年国債	730,000,000	609,995,300	

	159 20年国債	660,000,000	554,004,000	
	160 20年国債	710,000,000	598,863,700	
	161 20年国債	520,000,000	430,445,600	
	162 20年国債	620,000,000	509,342,400	
	163 20年国債	540,000,000	440,245,800	
	165 20年国債	520,000,000	411,996,000	
	166 20年国債	830,000,000	670,324,600	
	167 20年国債	480,000,000	374,116,800	
	168 20年国債	750,000,000	571,500,000	
	169 20年国債	500,000,000	372,185,000	
	170 20年国債	800,000,000	590,176,000	
	171 20年国債	450,000,000	329,166,000	
	172 20年国債	700,000,000	515,879,000	
	173 20年国債	550,000,000	401,940,000	
	174 20年国債	1,050,000,000	760,882,500	
	175 20年国債	660,000,000	481,892,400	
	176 20年国債	680,000,000	492,428,800	
	177 20年国債	510,000,000	359,886,600	
	178 20年国債	860,000,000	612,414,600	
	179 20年国債	510,000,000	360,136,500	
	180 20年国債	850,000,000	628,184,000	
	181 20年国債	480,000,000	358,603,200	
	182 20年国債	850,000,000	653,012,500	
	183 20年国債	450,000,000	361,444,500	
	184 20年国債	420,000,000	318,696,000	
	185 20年国債	690,000,000	520,011,600	
	186 20年国債	650,000,000	521,969,500	
	187 20年国債	490,000,000	378,319,200	
	188 20年国債	450,000,000	363,906,000	
	189 20年国債	320,000,000	270,672,000	
	190 20年国債	500,000,000	414,275,000	
	191 20年国債	520,000,000	443,814,800	
	192 20年国債	550,000,000	499,488,000	
	193 20年国債	300,000,000	275,997,000	
	194 20年国債	440,000,000	416,446,800	
	1 フィリピン共和国	100,000,000	98,917,700	
国債証券 合計			100,368,650,670	
地方債証券	797 東京都公債	100,000,000	94,588,000	

	866 東京都公債	200,000,000	191,167,400	
	5 東京都30年	100,000,000	51,796,000	
	28 東京都20年	100,000,000	97,368,000	
	3-5 北海道公債	100,000,000	91,433,400	
	262 神奈川県公債	300,000,000	277,301,100	
	457 大阪府公債	100,000,000	93,289,800	
	26-5 京都府20年	100,000,000	94,579,000	
	6-1 京都府5年	200,000,000	193,681,600	
	11兵庫県公債20年	100,000,000	100,642,600	
	8 静岡県20年	100,000,000	102,410,100	
	5-3 愛知県公債	100,000,000	90,946,600	
	6-1 愛知県5年	300,000,000	290,587,200	
	24-1 広島県20年	100,000,000	98,598,600	
	25-1 広島県20年	100,000,000	97,988,500	
	1 埼玉県15年	100,000,000	97,722,300	
	9 埼玉県20年	100,000,000	102,058,500	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	97,982,300	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	128,816,541	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	91,442,400	
	168 共同発行地方	100,000,000	99,007,800	
	170 共同発行地方	200,000,000	197,515,600	
	206 共同発行地方	200,000,000	187,167,400	
	244 共同発行地方	100,000,000	90,054,100	
	255 共同発行地方	300,000,000	275,952,000	
	270 共同発行地方	300,000,000	286,924,800	
	3-3 堺市公債	100,000,000	90,405,500	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	90,806,600	
	2-1 静岡市公債	100,000,000	92,681,200	
	6-1 大阪市5年	200,000,000	194,032,200	
	6-2 大阪市公債	200,000,000	182,967,600	
	11 名古屋市20年	100,000,000	102,009,200	
	10 京都市20年	100,000,000	99,819,700	
	24-3 神戸市20年	100,000,000	98,244,100	
	2-2 横浜市公債	100,000,000	93,130,200	
	6 札幌市20年	100,000,000	102,422,600	
	17 北九州市20年	100,000,000	95,417,000	
	2-1 千葉市公債	100,000,000	93,733,000	
地方債証券	合計		4,956,690,541	
特殊債券	86 政保政策投資C	300,000,000	286,536,900	

	47日本政策投資CO	100,000,000	97,893,600	
	174 日本政策投資	100,000,000	90,130,800	
	184 日本政策投資	200,000,000	193,422,800	
	79 政保道路機構	100,000,000	102,028,500	
	81 政保道路機構	100,000,000	102,007,800	
	97 政保道路機構	100,000,000	101,959,700	
	143 政保道路機構	200,000,000	200,184,000	
	235 政保道路機構	100,000,000	92,448,600	
	321 政保道路機構	100,000,000	98,385,800	
	397 政保道路機構	100,000,000	94,213,400	
	478 政保道路機構	300,000,000	276,719,700	
	23 地方公共団20	100,000,000	98,274,400	
	F163地方公共団体	100,000,000	99,330,500	
	F168地方公共団体	200,000,000	199,090,800	
	3 地方公共団15年	100,000,000	99,047,700	
	F231地方公共団体	100,000,000	97,748,900	
	129 地方公共団体	100,000,000	93,614,300	
	F568地方公共団体	300,000,000	249,332,400	
	95 日本政策金融	300,000,000	297,355,500	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	97,290,700	
	47 住宅機構RMBS	153,432,000	154,828,231	
	92 住宅機構RMBS	71,360,000	64,645,024	
	100 住宅機構RMBS	44,107,000	38,933,248	
	120 住宅機構RMBS	836,388,000	692,111,070	
	208 住宅機構RMBS	187,712,000	156,213,926	
	210 住宅機構RMBS	94,693,000	79,570,527	
	33 沖縄振興開発	100,000,000	90,722,100	
特殊債券 合計			4,344,040,926	
社債券	39 BPCE S.A.	100,000,000	97,417,900	
	4 香港上海銀行	100,000,000	99,222,500	
	33 首都高速道路	300,000,000	291,688,500	
	30 阪神高速道路	200,000,000	197,711,000	
	8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	97,904,500	
	111 東日本高速道	300,000,000	290,853,300	
	101 中日本高速道	200,000,000	195,084,200	
	88 西日本高速道	300,000,000	284,360,700	
	22 積水ハウス	100,000,000	97,435,400	
	11サントリーホールディング	100,000,000	97,573,200	
	3 伊藤園	100,000,000	96,757,100	

29 東急不動産HD	100,000,000	97,445,200	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	94,916,000	
35 東レ	100,000,000	95,162,700	
57 三井化学	200,000,000	198,182,200	
16 武田薬品	100,000,000	89,846,700	
32 住友電工	100,000,000	95,779,200	
16 クボタ	100,000,000	97,765,700	
34 ダイキン工業	200,000,000	193,906,800	
40 ソニーG	100,000,000	97,063,000	
31 トヨタ自動車	100,000,000	90,433,400	
4 オリックス銀行	100,000,000	97,038,900	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,477,000	
39 芙蓉総合リース	200,000,000	198,042,600	
5 NTTファイナンス	100,000,000	89,030,600	
33 NTTファイナンス	200,000,000	189,790,000	
38 NTTファイナンス	100,000,000	90,948,900	
58 日産フィナンシャル	200,000,000	195,757,400	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	97,200,500	
102 トヨタファイナンス	100,000,000	99,067,100	
103 トヨタファイナンス	200,000,000	193,721,200	
42 リコーリース	100,000,000	98,637,100	
214 オリックス	100,000,000	89,473,000	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,587,400	
82 三井不動産	100,000,000	97,386,200	
80 三菱地所	100,000,000	101,307,400	
143 三菱地所	100,000,000	91,113,900	
8 東日本旅客鉄道	100,000,000	99,441,700	
55 西日本鉄道	200,000,000	193,546,400	
52 阪急阪神HLDG	100,000,000	94,331,400	
20 三菱倉庫	100,000,000	93,957,900	
34 KDDI	100,000,000	95,146,700	
9 ソフトバンク	100,000,000	97,730,900	
46 光通信	100,000,000	97,153,900	
566 中部電力	200,000,000	179,704,800	
448 中国電力	100,000,000	90,109,200	
563 東北電力	200,000,000	180,012,200	
489 九州電力	100,000,000	93,915,100	
87 電源開発	100,000,000	90,132,300	
83 東京電力PG	200,000,000	192,635,800	

16 JERA	100,000,000	97,925,300	
65 東京瓦斯	100,000,000	92,781,600	
44 大阪瓦斯	100,000,000	90,063,600	
50 大阪瓦斯	100,000,000	97,564,700	
60 ソフトバンクグループ	100,000,000	99,651,200	
社債券 合計		6,995,893,100	
合計		116,665,275,237	

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

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	434,426,026	1,025,688,133
コール・ローン	1,072,730,214	239,597,985
投資証券	95,082,583,706	95,506,737,050
派生商品評価勘定	8,969	800,203
未収入金	-	335,108,987
未収配当金	328,390,466	320,675,076
流動資産合計	96,918,139,381	97,428,607,434
資産合計	96,918,139,381	97,428,607,434
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,163	58,763
未払金	-	704,426,775
未払解約金	367,142,000	119,631,000
流動負債合計	367,156,163	824,116,538
負債合計	367,156,163	824,116,538

純資産の部		
元本等		
元本 ※1	21,066,600,928	18,390,779,480
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	75,484,382,290	78,213,711,416
元本等合計	96,550,983,218	96,604,490,896
純資産合計	96,550,983,218	96,604,490,896
負債純資産合計	96,918,139,381	97,428,607,434

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	23,487,254,755円	21,066,600,928円
期中追加設定元本額	1,126,793,316円	648,172,371円
期中一部解約元本額	3,547,447,143円	3,323,993,819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）	809,787円	801,909円
ダイワ・グローバルREIT・ オープン（毎月分配型）	15,434,383,154円	13,487,772,869円
安定重視ポートフォリオ（奇数 月分配型）	9,318,008円	7,674,600円
インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	6,029,236円	5,399,826円
成長重視ポートフォリオ（奇数 月分配型）	37,275,741円	35,818,001円
6資産バランスファンド（分配 型）	55,001,494円	49,373,467円
6資産バランスファンド（成長 型）	191,494,036円	183,186,077円
りそな ワールド・リート・ファ ンド	730,846,305円	633,665,353円
ダイワ資産分散インカムオーブ ン（奇数月決算型）	17,007,270円	15,553,014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）	59,725,012円	32,451,613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）	977,379,256円	884,847,783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）	805,625,068円	166,152,315円
ダイワ・グローバルREIT・オープン（為替ヘッジなし／奇数月決算型）	7,779,717円	12,060,184円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	353,627,473円	380,334,865円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	480,993,494円	525,883,916円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	909,162,277円	1,025,134,279円
グローバルREITファンド2021-07（適格機関投資家専用）	801,890,944円	782,703,301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）	157,454,374円	134,927,564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）	10,590,282円	9,069,524円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	20,208,000円	17,969,020円
計	21,066,600,928円	18,390,779,480円
2. 期末日における受益権の総数	21,066,600,928口	18,390,779,480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2025年1月11日 至2026年1月13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	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△9,534,685,050	△765,339,243
合計	△9,534,685,050	△765,339,243

（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	2025年1月10日現在				2026年1月13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	23,115,010	-	23,106,041	8,969	724,801,963	-	724,001,760	800,203
アメリカ・ドル	-	-	-	-	683,334,683	-	682,538,059	796,624
イギリス・ ポンド	23,115,010	-	23,106,041	8,969	41,467,280	-	41,463,701	3,579
買建	23,115,010	-	23,100,847	△14,163	90,997,963	-	90,939,200	△58,763
アメリカ・ドル	23,115,010	-	23,100,847	△14,163	41,467,280	-	41,464,359	△2,921
オーストラリ ア・ドル	-	-	-	-	49,530,683	-	49,474,841	△55,842
合計	46,230,020	-	46,206,888	△5,194	815,799,926	-	814,940,960	741,440

（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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	4.5831円	5.2529円
(1万口当たり純資産額)	(45,831円)	(52,529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 REIT INC	55,949	10,341,053.670	
		BXP INC	137,125	9,175,033.750	
		EQUINIX REIT INC	18,257	14,310,932.020	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES REIT	33,737	3,180,724.360	
		HOST HOTELS & RESORTS REIT INC	416,455	7,637,784.700	
		KIMCO REALTY REIT CORP	543,054	11,186,912.400	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	353,646	6,114,539.340	
		INVITATION HOMES INC	383,938	10,228,108.320	
		LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A	45,052	5,838,739.200	
		AMERICOLD REALTY INC TRUST	67,491	894,255.750	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	193,357	5,746,570.040	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	9,731,656	5,303,752.520	
		CARETRUST REIT INC	81,932	3,065,076.120	

	WEYERHAEUSER REIT	116,959	3,011,694.250	
	CROWN CASTLE INC	183,961	15,634,845.390	
	CURLINE PROPERTIES	98,681	2,373,278.050	
	IRON MOUNTAIN INC	140,073	12,536,533.500	
	SUN COMMUNITIES REIT INC	60,076	7,454,830.840	
	PROLOGIS REIT INC	170,875	22,053,127.500	
	EASTGROUP PROPERTIES REIT INC	27,352	5,010,612.880	
	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC	41,573	10,396,991.570	
	WELLTOWER INC	245,411	45,813,325.480	
	HIGHWOODS PROPERTIES REIT INC	91,807	2,500,822.680	
	KILROY REALTY REIT CORP	165,329	6,419,725.070	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I	147,792	9,006,444.480	
	REALTY INCOME REIT CORP	93,473	5,504,624.970	
	PUBLIC STORAGE REIT	31,174	8,703,780.800	
	UDR REIT INC	198,005	7,167,781.000	
	AGREE REALTY REIT CORP	82,326	5,876,429.880	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN	82,698	3,675,099.120	
	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	185,407	29,270,203.090	
	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC	115,095	16,155,885.150	
アメリカ・ドル 小計			311,589,517.890 (49,318,388,891)	
イギリス・ポ ンド	HAMMERSON REIT PLC	292,012	1,006,273.350	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	934,843	1,336,825.490	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	2,017,273	2,057,618.460	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	1,775,897	1,484,649.890	
	LAND SECURITIES GROUP REIT PLC	979,938	6,154,010.640	
	SEGRO REIT PLC	1,056,063	7,719,820.530	
	BRITISH LAND REIT PLC	657,928	2,611,974.160	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	644,316	2,097,248.580	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	262,385	2,004,621.400	
	BIG YELLOW GROUP PLC	348,150	3,641,649.000	

	LONDONMETRIC PROPERTY REIT PLC	3,153,419	6,158,627.300	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	4,515,591	7,089,477.870	
イギリス・ポンド 小計			43,362,796.670 (9,244,948,251)	
オーストラリア・ドル	DEXUS STAPLED UNITS	2,570,185	17,811,382.050	
	SCENTRE GROUP UNIT	7,270,846	30,319,427.820	
	MIRVAC GROUP STAPLED UNITS	976,420	1,972,368.400	
	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	2,747,553	15,166,492.560	
	GOODMAN GROUP UNITS	2,153,474	65,293,331.680	
	CHARTER HALL GROUP STAPLED UNITS	686,547	16,566,379.110	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED	1,576,356	8,165,524.080	
オーストラリア・ドル 小計			155,294,905.700 (16,490,766,036)	
カナダ・ドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	501,048	6,623,854.560	
	FIRST CAPITAL REALTY REAL ESTATE I	328,281	6,411,327.930	
カナダ・ドル 小計			13,035,182.490 (1,486,401,860)	
シンガポール・ドル	CENTURION ACCOMMODATION REIT UNITS	7,265,800	8,355,670.000	
	KEPPEL DC REIT	1,913,700	4,286,688.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	8,134,700	19,767,321.000	
	KEPPEL REIT UNITS	14,301,087	14,086,570.690	
	PARKWAY LIFE REIT TRUST	1,325,977	5,542,583.860	
シンガポール・ドル 小計			52,038,833.550 (6,403,898,857)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST UNITS	2,683,908	5,314,137.840	
ニュージーランド・ドル 小計			5,314,137.840 (485,818,482)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	68,914	1,781,426.900	
	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	113,539	10,656,770.540	

		GECINA SA	33,484	2,702,158.800	
		KLEPIERRE REIT SA	348,866	11,777,716.160	
		MERCIALYS REIT SA	275,023	2,975,748.860	
		AEDIFICA NV	110,451	8,151,283.800	
		WAREHOUSES DE PAUW NV	259,564	6,084,180.160	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	121,708	3,535,617.400	
		MERLIN PROPERTIES REIT SA	533,069	6,737,992.160	
	ユーロ 小計			54,402,894.780 (10,042,230,347)	
	香港・ドル	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,889,592	100,211,050.560	
	香港・ドル 小計			100,211,050.560 (2,034,284,326)	
投資証券 合計				95,506,737,050 [95,506,737,050]	
合計				95,506,737,050 [95,506,737,050]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 32銘柄	100%	51.6%
イギリス・ポンド	投資証券 12銘柄	100%	9.7%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	17.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	1.6%
シンガポール・ドル	投資証券 5銘柄	100%	6.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 9銘柄	100%	10.5%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	2.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,305,167,018	2,723,782,529
株式	42,735,734,300	58,418,172,220
派生商品評価勘定	-	42,537,350
未収入金	94,078,970	444,858,705
未収配当金	63,386,500	74,867,250
差入委託証拠金	-	44,426,007
流動資産合計	44,198,366,788	61,748,644,061
資産合計	44,198,366,788	61,748,644,061
負債の部		
流動負債		
前受金	-	23,460,000
未払金	226,131,108	252,420,537
未払解約金	6,425,000	274,297,000
流動負債合計	232,556,108	550,177,537
負債合計	232,556,108	550,177,537
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	7,366,603,987	7,064,043,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,599,206,693	54,134,423,482
元本等合計	43,965,810,680	61,198,466,524
純資産合計	43,965,810,680	61,198,466,524
負債純資産合計	44,198,366,788	61,748,644,061

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	6,963,731,899円	7,366,603,987円
期中追加設定元本額	1,681,972,642円	935,721,644円
期中一部解約元本額	1,279,100,554円	1,238,282,589円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	5,665,281,307円	5,543,356,350円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,515,337円	9,896,963円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,475,525円	6,768,593円

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	198,130,502円	158,878,876円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	26,375,570円	19,504,780円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	182,392,429円	158,663,773円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	374,165,778円	341,866,151円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	896,267,539円	825,107,556円
計	7,366,603,987円	7,064,043,042円
2. 期末日における受益権の総数	7,366,603,987口	7,064,043,042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2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	244,747,018	9,254,070,337
合計	244,747,018	9,254,070,337

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2025年1月10日現在				2026年1月13日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	-	-	-	-	787,865,000	-	830,415,000	42,550,000
合計	-	-	-	-	787,865,000	-	830,415,000	42,550,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	5.9683円	8.6634円
(1万口当たり純資産額)	(59,683円)	(86,634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	
日鉄鉱業	110,400	2,930.00	323,472,000	
大 林 組	470,200	3,552.00	1,670,150,400	
長谷工コーポレーション	114,000	3,246.00	370,044,000	
鹿島建設	279,500	6,283.00	1,756,098,500	
関 電 工	122,500	5,622.00	688,695,000	
ジェイエイシーリクルートメント	138,300	1,066.00	147,427,800	
日本M&Aセンターホールデ	243,900	747.40	182,290,860	
森永乳業	75,200	3,835.00	288,392,000	
コカ・コーラボトラーズJHD	72,000	3,318.00	238,896,000	
日本たばこ産業	164,200	5,793.00	951,210,600	
グ ン ゼ	45,800	4,510.00	206,558,000	
富士紡ホールディングス	6,400	8,620.00	55,168,000	
ダイワボウHD	72,200	3,112.00	224,686,400	
地主	85,600	3,305.00	282,908,000	
オープンハウスグループ	67,300	9,517.00	640,494,100	
ジェイ・エス・ビー	16,100	3,400.00	54,740,000	
共和レザー	83,200	1,084.00	90,188,800	
T S I ホールディングス	2,100	1,082.00	2,272,200	

王子ホールディングス	336,200	907.40	305,067,880	
レンゴー	415,200	1,234.50	512,564,400	
日本曹達	93,800	3,680.00	345,184,000	
東ソー	65,000	2,468.50	160,452,500	
東亜合成	154,900	1,722.00	266,737,800	
日本触媒	33,300	2,134.00	71,062,200	
三井化学	171,600	2,053.50	352,380,600	
武田薬品	287,100	5,020.00	1,441,242,000	
アステラス製薬	337,600	2,258.00	762,300,800	
中国塗料	72,600	4,560.00	331,056,000	
パーク２４	136,100	2,214.50	301,393,450	
大塚商会	54,600	3,247.00	177,286,200	
デクセリアルズ	215,400	2,719.00	585,672,600	
ENEOSホールディングス	644,900	1,212.50	781,941,250	
住友ゴム	139,300	2,607.00	363,155,100	
アジアパイルHD	78,900	1,483.00	117,008,700	
ニチアス	26,000	7,384.00	191,984,000	
大和工業	44,600	11,430.00	509,778,000	
中部鋼鈑	40,000	2,305.00	92,200,000	
大同特殊鋼	78,600	1,980.00	155,628,000	
日本軽金属HD	48,500	2,699.00	130,901,500	
住友電工	556,800	6,479.00	3,607,507,200	
しずおかフィナンシャルグループ	201,400	2,603.50	524,344,900	
AREホールディングス	76,300	3,485.00	265,905,500	
マルゼン	60,000	3,670.00	220,200,000	
日本発条	20,000	2,643.50	52,870,000	
タクマ	121,100	2,513.00	304,324,300	
ツガミ	63,300	3,050.00	193,065,000	
オークマ	79,700	3,850.00	306,845,000	
オーエスジー	144,500	2,513.00	363,128,500	
ベルシステム24HLDGS	110,800	1,487.00	164,759,600	
小松製作所	435,400	5,281.00	2,299,347,400	
SANKYO	70,300	2,544.00	178,843,200	
竹内製作所	60,000	7,240.00	434,400,000	
ミネベアミツミ	85,000	3,075.00	261,375,000	
THK	61,500	4,170.00	256,455,000	
日立	60,100	5,330.00	320,333,000	
明電舎	32,600	5,970.00	194,622,000	
ダイヘン	18,500	11,240.00	207,940,000	
IDEC	57,700	2,941.00	169,695,700	

パナソニック ホールディング	222,400	2,150.50	478,271,200	
堀場製作所	11,300	17,135.00	193,625,500	
カシオ	52,600	1,317.00	69,274,200	
いすゞ自動車	352,000	2,603.50	916,432,000	
トヨタ自動車	624,000	3,641.00	2,271,984,000	
新明和工業	135,800	2,089.00	283,686,200	
プレス工業	312,200	857.00	267,555,400	
アイシン	614,200	3,078.00	1,890,507,600	
本田技研	353,000	1,603.50	566,035,500	
愛三工業	56,200	2,298.00	129,147,600	
萩原電気HLDGS	32,200	3,760.00	121,072,000	
ダイトロン	99,400	2,530.00	251,482,000	
シチズン時計	226,300	1,332.00	301,431,600	
イトーキ	115,400	2,529.00	291,846,600	
丸 紅	326,900	4,949.00	1,617,828,100	
豊田通商	119,500	5,862.00	700,509,000	
三井物産	313,900	5,000.00	1,569,500,000	
東京エレクトロン	34,800	41,030.00	1,427,844,000	
B I P R O G Y	85,900	5,544.00	476,229,600	
阪和興業	18,800	7,680.00	144,384,000	
丸井グループ	279,500	3,202.00	894,959,000	
三菱UFJフィナンシャルG	1,083,300	2,782.00	3,013,740,600	
三井住友トラストグルー	286,400	5,024.00	1,438,873,600	
三井住友フィナンシャルG	584,500	5,415.00	3,165,067,500	
ふくおかフィナンシャルG	98,000	5,457.00	534,786,000	
SBIホールディングス	70,400	3,640.00	256,256,000	
オリックス	139,300	4,773.00	664,878,900	
M S & A D	57,000	3,908.00	222,756,000	
東京海上HD	402,300	6,036.00	2,428,282,800	
T&Dホールディングス	215,500	3,934.00	847,777,000	
カチタス	44,900	3,215.00	144,353,500	
小田急電鉄	318,700	1,710.00	544,977,000	
山 九	19,500	8,774.00	171,093,000	
セイノーホールディングス	36,100	2,420.00	87,362,000	
九州旅客鉄道	23,900	4,105.00	98,109,500	
N T T	2,101,800	158.60	333,345,480	
K D D I	229,200	2,719.50	623,309,400	
ソフトバンク	6,307,600	216.50	1,365,595,400	
中部電力	268,200	2,211.00	592,990,200	
九州電力	243,000	1,756.50	426,829,500	

乃村工藝社	99,100	1,408.00	139,532,800	
合計			58,418,172,220	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	116,593,720	95,146,756
コール・ローン	16,402,815	39,154,877
株式	5,916,192,063	7,175,197,706
優先出資証券	1,559,309,401	1,957,402,726
投資証券	90,100,573	57,565,740
未収配当金	2,924,973	4,085,921
未収利息	4,839,576	5,628,837
流動資産合計	7,706,363,121	9,334,182,563
資産合計	7,706,363,121	9,334,182,563
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,065,000	24,964,000
流動負債合計	2,065,000	24,964,000
負債合計	2,065,000	24,964,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,028,818,913	1,087,898,816
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,675,479,208	8,221,319,747
元本等合計	7,704,298,121	9,309,218,563
純資産合計	7,704,298,121	9,309,218,563
負債純資産合計	7,706,363,121	9,334,182,563

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)優先出資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	1,015,888,611円	1,028,818,913円
期中追加設定元本額	124,798,515円	108,907,244円
期中一部解約元本額	111,868,213円	49,827,341円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	3,942,864円	3,164,768円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,507,902円	2,129,225円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	53,848,543円	51,564,867円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	7,083,785円	6,233,462円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	121,077,821円	124,639,320円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	250,780,275円	261,496,030円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	589,577,723円	638,671,144円
計	1,028,818,913円	1,087,898,816円
2. 期末日における受益権の総数	1,028,818,913口	1,087,898,816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2025年1月11日 至2026年1月13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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	68,789,885	315,847,547
優先出資証券	△72,678,609	△20,560,759
投資証券	△5,729,732	△1,932,089
合計	△9,618,456	293,354,699

(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

2025年1月10日現在	2026年1月13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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7,4885円 (74,885円)	8,5571円 (85,571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	PALO ALTO NETWORKS INC	800	188.880	151,104.000	
	ABBOTT LABORATORIES	2,000	124.640	249,280.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	600	209.420	125,652.000	
	ADOBE INC	600	327.650	196,590.000	
	AUTOZONE INC	35	3,523.000	123,305.000	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	660	262.800	173,448.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER INC	1,375	116.570	160,283.750	
	DANAHER CORP	690	239.000	164,910.000	
	ARCHER DANIELS MIDLAND	2,500	62.200	155,500.000	
	APPLE INC	12,000	260.250	3,123,000.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,800	39.840	151,392.000	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	1,100	498.670	548,537.000	
	BRISTOL MYERS SQUIBB	6,000	55.770	334,620.000	
	JPMORGAN CHASE	3,100	324.490	1,005,919.000	
	AMERIPRISE FINANCE INC	350	510.160	178,556.000	
	CATERPILLAR INC	900	629.770	566,793.000	
	CISCO SYSTEMS INC	3,900	74.010	288,639.000	
	MORGAN STANLEY	3,400	186.570	634,338.000	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,200	101.810	122,172.000	
	SS AND C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	1,400	85.940	120,316.000	
	BROADCOM INC	3,200	352.210	1,127,072.000	

DICKS SPORTING INC	600	215.580	129,348.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	400	263.970	105,588.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,200	98.830	118,596.000	
CARLISLE COMPANIES INC	500	356.220	178,110.000	
ROLLINS INC	2,000	61.010	122,020.000	
AECOM	600	99.440	59,664.000	
AMETEK INC	800	209.760	167,808.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV CLASS	3,000	48.200	144,600.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	150	943.080	141,462.000	
RELIANCE INC	230	310.060	71,313.800	
MERCADOLIBRE INC	100	2,149.900	214,990.000	
T MOBILE US INC	900	197.510	177,759.000	
EXPEDIA GROUP INC	1,000	291.530	291,530.000	
AMAZON COM INC	6,700	246.470	1,651,349.000	
EXXON MOBIL CORP	3,200	124.030	396,896.000	
EOG RESOURCES INC	1,000	105.440	105,440.000	
CENCORA INC	300	342.160	102,648.000	
FORD MOTOR	8,700	14.030	122,061.000	
NEXTERA ENERGY INC	2,000	81.120	162,240.000	
FREEPORT MCMORAN INC	2,200	58.710	129,162.000	
US BANCORP	2,800	54.390	152,292.000	
FISERV INC	800	68.200	54,560.000	
GE AEROSPACE	1,000	324.170	324,170.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	470	949.550	446,288.500	
ALPHABET INC CLASS A	9,000	331.860	2,986,740.000	
OWENS CORNING	800	123.000	98,400.000	
HALLIBURTON	4,000	31.900	127,600.000	
HOME DEPOT INC	1,200	374.940	449,928.000	
KRAFT HEINZ	2,500	23.390	58,475.000	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO	1,700	312.180	530,706.000	
CHENIERE ENERGY INC	500	193.440	96,720.000	
JOHNSON & JOHNSON	4,000	209.720	838,880.000	
ABBVIE INC	1,700	220.040	374,068.000	
KROGER	1,800	61.110	109,998.000	
ELI LILLY	600	1,081.000	648,600.000	
MCDONALDS CORP	600	306.750	184,050.000	
3M	1,100	167.940	184,734.000	

META PLATFORMS INC CLASS A	1,500	641.970	962,955.000	
METLIFE INC	1,500	78.320	117,480.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	500	385.640	192,820.000	
MERCK & CO INC	2,400	109.190	262,056.000	
MARSH & MCLENNAN INC	700	185.630	129,941.000	
VISTRA CORP	600	172.580	103,548.000	
NETAPP INC	1,320	107.030	141,279.600	
NIKE INC CLASS B	2,500	65.640	164,100.000	
RAYMOND JAMES INC	1,400	170.890	239,246.000	
EVERGY INC	2,100	73.360	154,056.000	
PAYCHEX INC	800	112.690	90,152.000	
ALTRIA GROUP INC	3,500	58.540	204,890.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	2,300	84.670	194,741.000	
PROCTER & GAMBLE	2,000	143.460	286,920.000	
DOCUSIGN INC	1,400	68.310	95,634.000	
PEPSICO INC	1,400	141.360	197,904.000	
CORTEVA INC	1,500	68.490	102,735.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	900	194.330	174,897.000	
ACCENTURE PLC CLASS A	400	280.960	112,384.000	
QUALCOMM INC	1,900	169.270	321,613.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	130	768.000	99,840.000	
BOOKING HOLDINGS INC	50	5,391.520	269,576.000	
RESMED INC	370	257.840	95,400.800	
CARRIER GLOBAL CORP	4,000	55.380	221,520.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	5,500	28.260	155,430.000	
CHEVRON CORP	2,700	162.340	438,318.000	
TESLA INC	2,000	448.960	897,920.000	
SHOPIFY SUBORDINATE VOTING INC CLA	1,500	167.930	251,895.000	
SOUTHERN	2,230	86.740	193,430.200	
SYSCO CORP	1,600	74.330	118,928.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	1,800	179.410	322,938.000	
SALESFORCE INC	600	259.400	155,640.000	
UNION PACIFIC CORP	820	229.500	188,190.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,000	340.510	340,510.000	
APPROVIN CORP CLASS A	300	658.650	197,595.000	
VERISIGN INC	740	248.660	184,008.400	
VALERO ENERGY CORP	900	179.620	161,658.000	

ELEVANCE HEALTH INC	220	374.970	82,493.400	
WALT DISNEY	1,300	112.820	146,666.000	
WELLS FARGO	2,700	94.960	256,392.000	
WILLIAMS INC	1,350	59.560	80,406.000	
WALMART INC	1,600	117.970	188,752.000	
TJX INC	2,000	157.100	314,200.000	
VISA INC CLASS A	1,500	343.200	514,800.000	
PULTEGROUP INC	1,400	133.230	186,522.000	
PPG INDUSTRIES INC	800	108.050	86,440.000	
NVIDIA CORP	18,000	184.940	3,328,920.000	
TYSON FOODS INC CLASS A	2,000	59.420	118,840.000	
NETFLIX INC	6,000	89.410	536,460.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	500	615.450	307,725.000	
ORACLE CORP	800	204.680	163,744.000	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY CLAS	1,900	48.850	92,815.000	
AMERICAN EXPRESS	1,000	359.590	359,590.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	1,000	86.900	86,900.000	
LINDE PLC	300	443.630	133,089.000	
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,800	207.690	373,842.000	
AVERY DENNISON CORP	900	187.970	169,173.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS COR	2,000	85.230	170,460.000	
EMERSON ELECTRIC	1,050	145.360	152,628.000	
APPLIED MATERIAL INC	1,000	307.240	307,240.000	
CME GROUP INC CLASS A	500	264.980	132,490.000	
GILEAD SCIENCES INC	1,200	122.600	147,120.000	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	1,500	131.380	197,070.000	
TE CONNECTIVITY PLC	800	235.400	188,320.000	
BLACKROCK INC	230	1,089.260	250,529.800	
FEDEX CORP	700	311.920	218,344.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	819	233.200	190,990.800	
ILLINOIS TOOL INC	700	254.540	178,178.000	
VERSANT MEDIA GROUP INC CLASS A WH	160	33.910	5,425.600	
INTUITIVE SURGICAL INC	400	572.745	229,098.000	
SNAP ON INC	360	358.140	128,930.400	
DUKE ENERGY CORP	1,740	116.710	203,075.400	

	TARGET CORP	1,100	106.140	116,754.000	
	CINTAS CORP	600	193.030	115,818.000	
	MICROSOFT CORP	5,200	477.180	2,481,336.000	
	MEDTRONIC PLC	1,250	96.950	121,187.500	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC CLASS A	1,400	54.920	76,888.000	
	EBAY INC	2,500	93.300	233,250.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	3,000	57.290	171,870.000	
	PROGRESSIVE CORP	1,000	216.500	216,500.000	
	INTUIT INC	300	635.440	190,632.000	
	COMCAST CORP CLASS A	4,000	29.060	116,240.000	
アメリカ・ドル 小計				44,570,514.950 (7,054,621,107)	
カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC	40	3,327.830	133,113.200	
	ROYAL BANK OF CANADA	2,000	235.310	470,620.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	4,300	44.810	192,683.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB VOT	100	2,609.950	260,995.000	
カナダ・ドル 小計				1,057,411.200 (120,576,599)	
合計				7,175,197,706 [7,175,197,706]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
優先出資 証券	アメリカ・ドル	REINSURANCE GROUP OF AMERICA INCOR FR	10,763	269,397.890	
		MORGAN STANLEY FR	8,412	206,935.200	
		AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD 5.5	1,982	39,818.380	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.625	3,572	86,978.200	
		AT&T INC 5.35	12,590	284,282.200	
		BANK OF AMERICA CORP 6	5,459	138,058.110	
		METLIFE INC 5.625	1,742	41,598.960	
		BANK OF AMERICA DEP REPRESENTING 5.875	5,987	147,938.770	
		US DS REPRESENTING PERP PREF SER 5.5	1,776	40,865.760	
		JPMORGAN CHASE & CO 5.75	8,159	204,872.490	

JPMORGAN CHASE & CO 6	10,922	275,998.940	
CMS ENERGY CORPORATION 5.875	12,484	297,930.660	
NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS IN 5.65	2,220	53,191.200	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION FR	18,139	444,858.970	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CORP FR	17,050	435,799.700	
ATHENE HOLDING LTD FR	1,100	27,467.000	
VOYA FINANCIAL DRC REPRESENTING P 5.35	3,887	96,553.080	
BANK AMER DS REPRESENTING NON CU 5.375	7,580	169,034.000	
ALLSTATE CORPORATION (THE) 5.1	9,983	212,538.070	
SEMPRA ENERGY 5.75	6,407	146,335.880	
AEGON FUNDING COMPANY LLC 5.1	1,761	35,202.390	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC 5.125	4,604	88,442.840	
AT&T INC 5	5,878	119,969.980	
WR BERKLEY CORPORATION 5.1	5,824	117,295.360	
METLIFE INC 4.75	18,913	375,423.050	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75	15,768	308,264.400	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION 4.8	3,415	62,562.800	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75	2,399	46,804.490	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC 4.5	5,300	90,842.000	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625	1,116	17,922.960	
WELLS FARGO & COMPANY 4.7	13,268	255,807.040	
BANK OF AMERICA CORP 4.375	17,428	318,932.400	
BANK OF AMERICA DRC CORP 4.125	9,313	160,879.280	
WELLS FARGO & COMPANY 4.375	9,469	171,388.900	
US BANCORP 4	1,142	18,852.470	
JPMORGAN CHASE DRC 4.55	12,497	244,441.320	

JPMORGAN CHASE NON-CUMULATIVE PREF 4.625	15,178	301,283.300	
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2	8,553	158,230.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD 4.2	6,986	112,754.040	
MORGAN STANLEY 4.25	6,675	118,681.500	
DTE ENERGY CO 4.375	10,302	180,388.020	
BANK OF AMERICA CORP 4.75	6,962	137,986.840	
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	2,492	63,446.320	
KEYCORP FR	5,574	140,687.760	
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	7,681	132,190.010	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INCOR FR	17,030	433,072.900	
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	2,100	56,385.000	
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I FR	3,250	84,175.000	
ALLSTATE DEP REPSTG TH NON CUM PE 7.375	3,154	83,044.820	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625	11,364	300,520.980	
F&G ANNUITIES & LIFE INC 7.95	3,815	97,664.000	
TPG OPERATING GROUP II LP 6.95	1,643	41,140.720	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC. 6.75	8,081	196,449.110	
M T BK DEP INT PERP PFD STK SER J 7.5	12,552	333,130.080	
MORGAN STANLEY 6.625	15,514	407,397.640	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION FR	2,201	56,059.470	
COREBRIDGE FINANCIAL INC 6.375	3,718	89,120.460	
SOUTHERN COMPANY (THE) 6.5	10,705	272,763.400	
NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS IN 6.5	15,174	384,205.680	

		KKR & CO INC 6.875	9,044	229,174.960	
		COMERICA INCORPORATED FR	12,201	317,836.050	
		DTE ENERGY COMPANY 6.25	16,788	415,838.760	
		XCEL ENERGY INC 6.25	11,502	288,585.180	
		M&T BANK CORPORATION 6.35	13,596	345,406.380	
		MORGAN STANLEY DS FR	7,299	184,153.770	
		MORGAN STANLEY FR	2,430	61,867.800	
		MORGAN STANLEY DS REPRESENTING F FR	11,551	289,583.570	
		アメリカ・ドル 小計		12,366,709.160 (1,957,402,726)	
優先出資証券 合計			1,957,402,726 [1,957,402,726]		
投資証券	アメリカ・ドル	PUBLIC STORAGE 4.625	10,866	205,258.740	
		PUBLIC STORAGE 3.9	10,034	158,436.860	
	アメリカ・ドル 小計		363,695.600 (57,565,740)		
投資証券 合計			57,565,740 [57,565,740]		
合計			2,014,968,466 [2,014,968,466]		

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 優先出資 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 140銘柄				
	優先出資証券 67銘柄	77.8%	21.6%	0.6%	98.7%
	投資証券 2銘柄				
カナダ・ドル	株式 4銘柄	100%	-%	-%	1.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	11,678,531	89,528,681
コール・ローン	13,327,065	14,941,464
株式	1,926,206,590	2,308,681,697
未収配当金	1,073,513	865,946
流動資産合計	1,952,285,699	2,414,017,788
資産合計	1,952,285,699	2,414,017,788
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,402,000	979,000
流動負債合計	2,402,000	979,000
負債合計	2,402,000	979,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	618,083,228	583,092,795
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,331,800,471	1,829,945,993
元本等合計	1,949,883,699	2,413,038,788
純資産合計	1,949,883,699	2,413,038,788
負債純資産合計	1,952,285,699	2,414,017,788

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	614,800,738円	618,083,228円
期中追加設定元本額	83,526,367円	43,615,702円
期中一部解約元本額	80,243,877円	78,606,135円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,276,100円	6,446,571円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,049,278円	4,352,277円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	129,848,068円	106,170,438円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	16,886,253円	12,911,758円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	57,069,059円	55,588,182円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	116,787,244円	116,336,398円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	282,167,226円	281,287,171円
計	618,083,228円	583,092,795円
2. 期末日における受益権の総数	618,083,228口	583,092,795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2025年1月11日 至2026年1月13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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△61,642,851	112,876,749
合計	△61,642,851	112,876,749

（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

2025年1月10日現在	2026年1月13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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1547円 (31,547円)	4.1383円 (41,383円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	12,894	26.615	343,173.810	
	MAGNUM ICE CREAM NV	1,203	11.320	13,617.960	
	UNILEVER PLC	5,347	47.705	255,078.630	
	AVIVA PLC	33,880	6.768	229,299.840	
	GLAXOSMITHKLINE	13,944	18.770	261,728.880	
	M&G PLC	75,373	2.952	222,501.090	
	ASTRAZENECA PLC	2,802	141.200	395,642.400	
	NATIONAL GRID PLC	24,842	11.785	292,762.970	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	275,268	1.010	278,020.680	
	HSBC HOLDINGS PLC	44,562	12.024	535,813.480	
イギリス・ポンド 小計				2,827,639.740 (602,852,793)	
スイス・フラン	NESTLE SA	6,118	74.990	458,788.820	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	642	576.200	369,920.400	
	NOVARTIS AG	4,813	113.840	547,911.920	
	GIVAUDAN SA	86	3,196.000	274,856.000	
スイス・フラン 小計				1,651,477.140 (327,686,094)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK CLASS B	3,608	379.100	1,367,792.800	
デンマーク・クローネ 小計				1,367,792.800 (33,784,482)	
ユーロ	SIEMENS N AG	3,071	258.350	793,392.850	
	BMW AG	3,286	90.480	297,317.280	

BASF N	4,032	44.770	180,512.640	
ALLIANZ	1,104	380.000	419,520.000	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESE	636	525.000	333,900.000	
DEUTSCHE TELEKOM N AG	15,388	28.690	441,481.720	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	7,134	33.660	240,130.440	
KONINKLIJKE KPN NV	89,223	3.836	342,259.420	
TOTALENERGIES	5,604	55.310	309,957.240	
MICHELIN	9,451	30.060	284,097.060	
SCHNEIDER ELECTRIC	2,301	236.800	544,876.800	
BNP PARIBAS SA	3,187	86.980	277,205.260	
DANONE SA	3,722	77.360	287,933.920	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA	2,497	86.820	216,789.540	
CAPGEMINI	1,919	144.450	277,199.550	
PUBLICIS GROUPE SA	1,733	87.500	151,637.500	
AXA SA	9,407	39.750	373,928.250	
SANOFI SA	2,749	82.410	226,545.090	
INTESA SANPAOLO	73,727	5.991	441,698.450	
ENI	14,180	16.080	228,014.400	
ENEL	49,171	9.273	455,962.680	
ENAGAS SA	6,494	13.790	89,552.260	
KINGSPAN GROUP PLC	936	73.750	69,030.000	
ユーロ 小計			7,282,942.350 (1,344,358,328)	
合計			2,308,681,697 [2,308,681,697]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	26.1%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	14.2%

デンマーク・クローネ	株式	1銘柄	100%	1.5%
ユーロ	株式	23銘柄	100%	58.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	16,094,262	20,723,475
コール・ローン	1,368,630	539,887
株式	749,457,633	876,417,224
派生商品評価勘定	-	5,275
未収入金	-	2,975,278
未収配当金	775,564	343,739
流動資産合計	767,696,089	901,004,878
資産合計	767,696,089	901,004,878
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	685	125,994
未払解約金	1,041,000	17,846,000
流動負債合計	1,041,685	17,971,994
負債合計	1,041,685	17,971,994
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	177,230,517	133,760,334
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	589,423,887	749,272,550
元本等合計	766,654,404	883,032,884
純資産合計	766,654,404	883,032,884

負債純資産合計	767,696,089	901,004,878
---------	-------------	-------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	195,040,700円	177,230,517円
期中追加設定元本額	27,051,933円	13,602,598円
期中一部解約元本額	44,862,116円	57,072,781円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,835,563円	4,317,254円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,381,100円	2,891,746円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	94,919,487円	69,908,908円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	12,281,765円	8,767,370円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	7,391,876円	5,600,790円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	15,208,097円	12,634,336円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	36,212,629円	29,639,930円
計	177,230,517円	133,760,334円
2. 期末日における受益権の総数	177,230,517口	133,760,334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2025年1月11日 至2026年1月13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	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△3,801,973	135,593,836
合計	△3,801,973	135,593,836

（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	2025年1月10日現在				2026年1月13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	1,100,000	-	1,100,685	△685	21,300,000	-	21,420,719	△120,719
アメリカ・ドル	1,100,000	-	1,100,685	△685	21,300,000	-	21,420,719	△120,719
合計	1,100,000	-	1,100,685	△685	21,300,000	-	21,420,719	△120,719

（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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	4.3257円	6.6016円
(1万口当たり純資産額)	(43,257円)	(66,016円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	5,520	35.890	198,112.800	
	BHP GROUP LTD	5,200	46.510	241,852.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	3,478	23.720	82,498.160	
	FORTESCUE LTD	3,200	22.400	71,680.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,200	41.620	133,184.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION CORP	5,400	38.080	205,632.000	
	RIO TINTO LTD	660	142.430	94,003.800	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,750	154.080	269,640.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	5,400	19.820	107,028.000	
	MACQUARIE GROUP LTD DEF	400	205.430	82,172.000	
	CSL LTD	245	175.100	42,899.500	
	WESFARMERS LTD	1,470	82.230	120,878.100	
	BRAMBLES LTD	3,900	23.240	90,636.000	
オーストラリア・ドル 小計				1,740,216.360 (184,793,576)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	32,700	2.920	95,484.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	3,800	57.870	219,906.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING LTD	8,300	19.900	165,170.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	30,400	4.460	135,584.000	

シンガポール・ドル 小計				616,144.000 (75,822,680)	
韓国・ウォン	KIA CORPORATION CORP	990	129,300.000	128,007,000.000	
	SK HYNIX INC	950	749,000.000	711,550,000.000	
	HYUNDAI MOTOR	575	367,000.000	211,025,000.000	
	KT&G CORP	380	143,700.000	54,606,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,100	125,500.000	138,050,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS LTD	5,695	138,800.000	790,466,000.000	
	SK TELECOM LTD	2,600	53,000.000	137,800,000.000	
韓国・ウォン 小計				2,171,504,000.000 (233,436,680)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	5,500	57.200	314,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	4,000	70.950	283,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT LTD	19,000	30.800	585,200.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	20,000	22.180	443,600.000	
	AIA GROUP LTD	15,200	83.700	1,272,240.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES LTD	4,000	99.100	396,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	23,000	39.700	913,100.000	
香港・ドル 小計				4,208,940.000 (85,441,483)	
台湾・ドル	ASE TECHNOLOGY HOLDING LTD	19,000	283.000	5,377,000.000	
	WIWYNN CORPORATION CORP	400	4,095.000	1,638,000.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	7,500	1,055.000	7,912,500.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY LTD	5,000	235.500	1,177,500.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	539.000	2,156,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	6,000	280.500	1,683,000.000	
	MEDIATEK INC	3,000	1,445.000	4,335,000.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING LTD	33,415	95.000	3,174,425.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	9,000	243.500	2,191,500.000	
	GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	2,435.000	2,435,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	10,300	1,690.000	17,407,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	29,000	228.500	6,626,500.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	1,000	546.000	546,000.000	
	UNITED MICRO ELECTRONICS CORP	49,000	55.300	2,709,700.000	
台湾・ドル 小計				59,369,125.000 (296,922,805)	

合計			876,417,224	
			[876,417,224]	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリア・ドル	株式 13銘柄	100%	21.1%
シンガポール・ドル	株式 4銘柄	100%	8.7%
韓国・ウォン	株式 7銘柄	100%	26.6%
香港・ドル	株式 7銘柄	100%	9.7%
台湾・ドル	株式 14銘柄	100%	33.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」－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

	2025年1月10日現在 金 額 (円)	2026年1月13日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,692,978,552	3,448,571,564
投資証券 ※2	167,077,202,429	218,079,967,000
派生商品評価勘定	31,680,080	155,680,000
未収入金	744,480,634	97,038,636
未収配当金	2,119,421,366	2,389,944,537

流動資産合計	172,665,763,061	224,171,201,737
資産合計	172,665,763,061	224,171,201,737
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,397,430	-
前受金	33,943,500	151,056,000
未払金	532,279,192	828,387,086
未払解約金	13,340,000	49,429,000
流動負債合計	580,960,122	1,028,872,086
負債合計	580,960,122	1,028,872,086
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	51,527,578,463	51,362,346,901
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	120,557,224,476	171,779,982,750
元本等合計	172,084,802,939	223,142,329,651
純資産合計	172,084,802,939	223,142,329,651
負債純資産合計	172,665,763,061	224,171,201,737

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	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。 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	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1. ※1 期首	2024年1月11日	2025年1月11日
期首元本額	49,244,470,777円	51,527,578,463円
期中追加設定元本額	8,929,114,317円	1,778,093,780円
期中一部解約元本額	6,646,006,631円	1,943,325,342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）	17,573,759円	13,467,761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）	92,973,536円	66,783,715円
	ダイワ・アクティブJリート・ファンド（年4回決算型）	487,810,483円	499,988,383円
	計	51,527,578,463円	51,362,346,901円
2.	期末日における受益権の総数	51,527,578,463口	51,362,346,901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 610,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 720,500,000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2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年1月13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	2025年1月10日現在	2026年1月13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	△2,996,517,515	5,471,452,861
合計	△2,996,517,515	5,471,452,861

（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	2025年1月10日現在				2026年1月13日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								

不動産投信 指数先物取引								
買建	2,796,709,000	-	2,827,182,500	30,473,500	3,079,344,000	-	3,235,200,000	155,856,000
合計	2,796,709,000	-	2,827,182,500	30,473,500	3,079,344,000	-	3,235,200,000	155,856,000

(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)

	2025年1月10日現在	2026年1月13日現在
1口当たり純資産額	3.3397円	4.3445円
(1万口当たり純資産額)	(33,397円)	(43,445円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	662	87,847,400	
	サンケイリアルエステート	1,263	158,001,300	
	SOSILA物流リート投	4,244	563,603,200	
	三井不動産アコモデーションファン ド投資法人	56,182	7,781,207,000	
	森ヒルズリート	17,523	2,635,459,200	
	産業ファンド	6,150	968,010,000	
	アドバンス・レジデンス	27,627	4,815,386,100	
	A P I 投資法人	25,784	3,748,993,600	
	G L P 投資法人	90,407	13,723,782,600	

コンフォリア・レジデンシャル	15,881	5,407,480,500	
日本プロロジスリート	120,507	11,665,077,600	
星野リゾート・リート	7,755	2,017,075,500	
One リート投資法人	10,200	936,360,000	
ヒューリックリート投資法	10,898	1,947,472,600	
日本リート投資法人	33,513	3,301,030,500	
積水ハウス・リート投資	12,882	1,164,532,800	
トーセイ・リート投資法人	10,054	1,485,981,200	
野村不動産マスターF	84,321	14,730,878,700	
ラサールロジポート投資	32,386	5,220,623,200	
スターアジア不動産投	53,960	3,388,688,000	
三井不ロジパーク	9,054	1,135,371,600	
投資法人みらい	4,615	236,288,000	
三菱地所物流REIT	45,025	6,141,410,000	
CREロジスティクスファンド	11,046	1,912,062,600	
セントラル・リート投資法人	4,591	546,788,100	
霞ヶ関ホテルリート	2,530	273,240,000	
日本ビルファンド	114,759	16,536,771,900	※
ジャパンリアルエステイト	91,345	11,774,370,500	
日本都市ファンド投資法人	120,095	14,975,846,500	
オリックス不動産投資	49,132	5,286,603,200	
日本プライムリアルティ	77,244	8,126,068,800	
NTT都市開発リート投資法人	15,154	2,168,537,400	
東急リアル・エステート	2,464	510,787,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	10,050	1,875,330,000	
森トラストリート投資法人	17,752	1,404,183,200	
インヴィンシブル投資法人	122,621	8,056,199,700	
フロンティア不動産投資	44,399	4,182,385,800	
平和不動産リート	779	124,484,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	40,192	4,264,371,200	
KDX不動産投資法人	74,359	13,168,978,900	
いちごオフィスリート投資法人	25,980	2,530,452,000	
大和証券オフィス投資法人	7,170	2,738,940,000	
スターツプロシード投資法人	5,076	1,066,467,600	
大和ハウスリート投資法人	66,489	9,468,033,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	87,036	7,311,024,000	
大和証券リビング投資法人	25,811	3,017,305,900	
ジャパンエクセレント投資法人	23,073	3,500,174,100	
投資証券 合計		218,079,967,000	

合計		218,079,967,000	
----	--	-----------------	--

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 5,000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。

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2025年1月11日から2026年1月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	207,573,524	251,596,948
親投資信託受益証券	13,502,502,125	16,637,909,973
未収入金	201,000	87,198,000
流動資産合計	13,710,276,649	16,976,704,921
資産合計	13,710,276,649	16,976,704,921
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,046,829	100,127,829
未払受託者報酬	3,687,364	4,392,549
未払委託者報酬	73,748,091	87,851,910
その他未払費用	553,012	658,790
流動負債合計	85,035,296	193,031,078
負債合計	85,035,296	193,031,078
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 5,165,687,004	※ 1 5,459,134,609
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,459,554,349	11,324,539,234
（分配準備積立金）	3,347,764,436	5,348,350,237
元本等合計	13,625,241,353	16,783,673,843
純資産合計	13,625,241,353	16,783,673,843
負債純資産合計	13,710,276,649	16,976,704,921

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期 自 2024年1月11日 至 2025年1月10日	第20期 自 2025年1月11日 至 2026年1月13日
営業収益		
受取利息	219,441	892,766
有価証券売買等損益	1,245,474,256	2,529,541,848
営業収益合計	1,245,693,697	2,530,434,614
営業費用		
支払利息	1,458	-
受託者報酬	7,117,962	8,128,131
委託者報酬	※1 142,361,084	※1 162,564,341
その他費用	1,067,525	1,219,041
営業費用合計	150,548,029	171,911,513
営業利益又は営業損失（△）	1,095,145,668	2,358,523,101
経常利益又は経常損失（△）	1,095,145,668	2,358,523,101
当期純利益又は当期純損失（△）	1,095,145,668	2,358,523,101
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（△）	79,780,258	62,584,472
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,862,251,069	8,459,554,349
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,333,209,617	1,378,184,666
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,333,209,617	1,378,184,666
剰余金減少額又は欠損金増加額	751,271,747	809,138,410
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	751,271,747	809,138,410
分配金	※2 -	※2 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,459,554,349	11,324,539,234

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2026年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を2026年1月13日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1. ※1 期首元本額	4,848,519,962円	5,165,687,004円
期中追加設定元本額	844,341,408円	786,610,685円
期中一部解約元本額	527,174,366円	493,163,080円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,165,687,004口	5,459,134,609口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第19期 自2024年1月11日 至2025年1月10日	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	21,293,637円	23,975,088円

2. ※2 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (187,892円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (1,015,142,511円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (5,315,652,204円) 及び分配準備積立金 (2,332,434,033円) より分配対象額は8,663,416,640円 (1万口当たり16,771.08円) であり、分配を行っておりません。	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 (824,001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 (2,295,114,628円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (6,103,145,554円) 及び分配準備積立金 (3,052,411,608円) より分配対象額は11,451,495,791円 (1万口当たり20,976.76円) であり、分配を行っておりません。
----------------	--	---

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	第20期
	2026年1月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,154,004,089	2,448,400,353
合計	1,154,004,089	2,448,400,353

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6376円 (26,376円)	3.0744円 (30,744円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	667,024,269	2,744,337,949	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	2,347,278,015	2,611,816,247	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	525,883,916	2,762,415,622	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	341,866,151	2,961,723,212	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	261,496,030	2,237,647,678	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	116,336,398	481,434,915	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	12,634,336	83,406,832	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	634,164,465	2,755,127,518	
親投資信託受益証券 合計			16,637,909,973	
合計			16,637,909,973	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2025年1月11日から2026年1月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	325,234,539	413,191,188
親投資信託受益証券	21,430,010,816	27,356,810,806
未収入金	12,390,000	154,668,000
流動資産合計	21,767,635,355	27,924,669,994
資産合計	21,767,635,355	27,924,669,994
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,562,898	157,839,621
未払受託者報酬	5,221,958	7,116,651
未払委託者報酬	120,106,262	163,683,967
その他未払費用	783,209	1,067,405
流動負債合計	142,674,327	329,707,644
負債合計	142,674,327	329,707,644
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,766,258,842	※1 7,041,299,468
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,858,702,186	20,553,662,882
（分配準備積立金）	5,542,737,321	9,931,221,055
元本等合計	21,624,961,028	27,594,962,350
純資産合計	21,624,961,028	27,594,962,350
負債純資産合計	21,767,635,355	27,924,669,994

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期 自 2024年1月11日 至 2025年1月10日	第20期 自 2025年1月11日 至 2026年1月13日
営業収益		
受取利息	318,960	1,478,389
有価証券売買等損益	2,289,826,891	5,372,496,990
営業収益合計	2,290,145,851	5,373,975,379
営業費用		
支払利息	1,992	-
受託者報酬	9,867,513	13,033,474
委託者報酬	※1 226,954,699	※1 299,771,859
その他費用	1,479,958	1,954,849
営業費用合計	238,304,162	314,760,182
営業利益又は営業損失（△）	2,051,841,689	5,059,215,197
経常利益又は経常損失（△）	2,051,841,689	5,059,215,197
当期純利益又は当期純損失（△）	2,051,841,689	5,059,215,197
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（△）	159,360,167	141,041,361
期首剰余金又は期首欠損金（△）	10,118,217,906	14,858,702,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,062,868,956	2,309,972,370
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,062,868,956	2,309,972,370
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,214,866,198	1,533,185,510
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,214,866,198	1,533,185,510
分配金	※2 -	※2 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,858,702,186	20,553,662,882

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2026年1月10日、その翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を2026年1月13日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1. ※1 期首元本額	5,535,598,650円	6,766,258,842円
期中追加設定元本額	1,887,298,973円	971,685,316円
期中一部解約元本額	656,638,781円	696,644,690円
2. 計算期間末日における受益権の総数	6,766,258,842口	7,041,299,468口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第19期 自2024年1月11日 至2025年1月10日	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	39,534,201円	51,549,815円

2. ※2 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (293,160円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (1,892,147,918円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (9,441,261,632円) 及び分配準備積立金 (3,650,296,243円) より分配対象額は14,983,998,953円 (1万口当たり22,145.18円) であり、分配を行っておりません。	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 (1,383,961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 (4,916,789,875円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (10,622,441,827円) 及び分配準備積立金 (5,013,047,219円) より分配対象額は20,553,662,882円 (1万口当たり29,190.16円) であり、分配を行っておりません。
----------------	---	--

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13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	第20期
	2026年1月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,154,460,654	5,211,858,268
合計	2,154,460,654	5,211,858,268

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自2025年1月11日 至2026年1月13日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第19期 2025年1月10日現在	第20期 2026年1月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1960円 (31,960円)	3.9190円 (39,190円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	325,466,179	1,339,065,500	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	1,148,627,419	1,278,077,729	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,025,134,279	5,384,927,854	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	825,107,556	7,148,236,800	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	638,671,144	5,465,172,846	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	281,287,171	1,164,050,699	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	29,639,930	195,670,961	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	1,238,717,555	5,381,608,417	
親投資信託受益証券 合計			27,356,810,806	
合計			27,356,810,806	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」－REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2026年1月14日から2026年7月13日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	200,449,509
親投資信託受益証券	13,597,773,276
未収入金	11,668,000
流動資産合計	13,809,890,785
資産合計	13,809,890,785
負債の部	
流動負債	
未払解約金	23,585,184
未払受託者報酬	3,673,038
未払委託者報酬	62,442,134
その他未払費用	550,861
流動負債合計	90,251,217
負債合計	90,251,217
純資産の部	
元本等	
元本	※1 5,285,113,443
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,434,526,125
（分配準備積立金）	3,173,189,022
元本等合計	13,719,639,568
純資産合計	13,719,639,568
負債純資産合計	13,809,890,785

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2026年1月14日	
至 2026年7月13日	
営業収益	
受取利息	611,802
有価証券売買等損益	349,574,797
その他収益	3,333
営業収益合計	350,189,932
営業費用	
受託者報酬	3,673,038
委託者報酬	※ 1 62,442,134
その他費用	550,861
営業費用合計	66,666,033
営業利益又は営業損失（△）	283,523,899
経常利益又は経常損失（△）	283,523,899
中間純利益又は中間純損失（△）	283,523,899
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,693,011
期首剰余金又は期首欠損金（△）	8,064,388,933
剰余金増加額又は欠損金減少額	582,528,695
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	582,528,695
剰余金減少額又は欠損金増加額	492,222,391
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	492,222,391
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,434,526,125

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. ※1 期首元本額	5,229,242,455円
期中追加設定元本額	375,016,573円
期中一部解約元本額	319,145,585円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,285,113,443口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	8,317,413円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2026年7月13日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5959円 (25,959円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,360,410,625
コール・ローン	956,442,425
国債証券	417,394,968,590

派生商品評価勘定	741,338
未収入金	10,627
未収利息	3,769,718,849
前払費用	279,156,513
流動資産合計	423,761,448,967
資産合計	423,761,448,967
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,936,620
未払金	734,010
未払解約金	286,974,163
その他未払費用	8,140
流動負債合計	289,652,933
負債合計	289,652,933
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	100,857,691,344
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	322,614,104,690
元本等合計	423,471,796,034
純資産合計	423,471,796,034
負債純資産合計	423,761,448,967

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	96,991,845,405円
期中追加設定元本額	10,961,946,215円
期中一部解約元本額	7,096,100,276円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスV A	239,177,543円

ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,516,321円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	13,607,695円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,157,427円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	119,935,738円
外国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	1,119,071,678円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	742,223,973円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	1,143,711,787円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	11,449,529,333円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	943,169,688円
D-I's 外国債券インデックス	1,406,549円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	35,305,476円
iFree 外国債券インデックス	1,148,220,346円
iFree 8資産バランス	3,699,989,715円
iFree 年金バランス	886,471,214円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	5,420,598円
DCダイワ外国債券インデックス	49,158,383,178円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,208,697,364円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,065,890,542円
ダイワ・ライフ・バランス70	936,016,178円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	806,170,551円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	685,894,830円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	335,944,693円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	34,276,336円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	39,430,619円
ダイワつみたてインデックス外国債券	3,378,578,686円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,676,688円
ダイワつみたてインデックスバランス50	4,167,142円
ダイワつみたてインデックスバランス70	48,223,961円

ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	3,431,770,795円
ダイワ世界バランスファンド40VA	49,294,374円
ダイワ世界バランスファンド60VA	24,192,251円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,862,176,991円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	122,829,013円
スタイル9（4資産分散・保守型）	220,468円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	5,230,740円
スタイル9（4資産分散・積極型）	6,351,236円
スタイル9（6資産分散・保守型）	80,910円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,810,577円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,262,671円
スタイル9（8資産分散・保守型）	251,994円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,444,827円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,433,760円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	928,574,771円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	390,221円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	304,695円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	217,268円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	133,135円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	30,331円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	98,933,840円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	69,933,168円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	8,701,165,584円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,176,262,679円
ダイワライフスタイル25	20,699,295円
ダイワライフスタイル50	57,950,519円
ダイワライフスタイル75	18,479,382円
計	100,857,691,344円
2. 期末日における受益権の総数	100,857,691,344口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	670,622,030	-	669,426,748	△1,195,282
アメリカ・ドル	180,614,082	-	180,429,633	△184,449
イギリス・ポンド	86,043,160	-	86,593,680	550,520
イスラエル・シケル	65,327,040	-	64,399,320	△927,720
オフショア・人民元	100,543,972	-	100,367,136	△176,836
カナダ・ドル	35,075,640	-	35,093,661	18,021
シンガポール・ドル	62,804,300	-	62,651,750	△152,550
ニュージーランド・ドル	18,460,600	-	18,626,320	165,720

ユーロ	121,753,236	-	121,265,248	△487,988
合計	670,622,030	-	669,426,748	△1,195,282

(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)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	4.1987円
(1万口当たり純資産額)	(41,987円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	447,841,764
国債証券	111,231,601,360
地方債証券	4,936,175,571
特殊債券	3,937,741,510

社債券	6,600,003,300
未収入金	89,899,000
未収利息	279,127,370
前払費用	27,767,595
流動資産合計	127,550,157,470
資産合計	127,550,157,470
負債の部	
流動負債	
未払金	378,653,000
未払解約金	9,817,996
流動負債合計	388,470,996
負債合計	388,470,996
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	117,390,414,225
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,771,272,249
元本等合計	127,161,686,474
純資産合計	127,161,686,474
負債純資産合計	127,550,157,470

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	105,238,578,046円
期中追加設定元本額	12,863,904,135円
期中一部解約元本額	712,067,956円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	7,070,418,627円
日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	43,032,211,468円
i F r e e 日本債券インデックス	2,078,790,421円
i F r e e 8資産バランス	14,062,441,189円
ダイワ・ライフ・バランス30	16,439,742,984円
ダイワ・ライフ・バランス50	16,120,160,655円
ダイワ・ライフ・バランス70	7,132,506,501円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	3,075,306,227円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	2,577,907,672円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	1,255,484,675円
ダイワつみたてインデックス日本債券	3,832,256,839円
ダイワつみたてインデックスバランス30	79,913,087円
ダイワつみたてインデックスバランス50	64,168,589円
ダイワつみたてインデックスバランス70	372,743,692円
ダイワ世界バランスファンド40VA	136,991,022円
ダイワ世界バランスファンド60VA	56,472,926円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	1,838,452円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	727,001円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	299,035円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	33,163円
計	117,390,414,225円
2. 期末日における受益権の総数	117,390,414,225口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2026年7月13日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0832円 (10,832円)

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	441,580,305
コール・ローン	370,841,027
投資証券	94,963,562,604
派生商品評価勘定	265,150
未収入金	917,614,571

未収配当金	360,100,745
流動資産合計	97,053,964,402
資産合計	97,053,964,402
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	511,200
未払金	47,096,954
未払解約金	70,230,000
その他未払費用	8,140
流動負債合計	117,846,294
負債合計	117,846,294
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	16,587,374,786
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	80,348,743,322
元本等合計	96,936,118,108
純資産合計	96,936,118,108
負債純資産合計	97,053,964,402

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	18,390,779,480円
期中追加設定元本額	311,349,422円
期中一部解約元本額	2,114,754,116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）	796,882円
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	12,507,856,508円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,076,567円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,690,992円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	35,752,256円

6資産バランスファンド（分配型）	42,547,708円
6資産バランスファンド（成長型）	174,268,774円
りそな ワールド・リート・ファンド	582,275,036円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	13,558,383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）	22,888,134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）	997,236,275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）	150,383,722円
ダイワ・グローバルREIT・オープン（為替ヘッジなし／奇数月決算型）	12,037,200円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	356,914,330円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	520,257,527円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	1,013,998,837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）	120,579,241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）	8,508,120円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	16,748,294円
計	16,587,374,786円
2. 期末日における受益権の総数	16,587,374,786口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,157,327,495	-	1,157,827,266	△499,771
アメリカ・ドル	972,114,000	-	972,625,200	△511,200
イギリス・ポンド	92,919,797	-	92,912,214	7,583
ユーロ	92,293,698	-	92,289,852	3,846
買建	185,213,495	-	185,467,216	253,721
アメリカ・ドル	185,213,495	-	185,467,216	253,721
合計	1,342,540,990	-	1,343,294,482	△246,050

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
 に評価しております。

- ① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	5.8440円
(1万口当たり純資産額)	(58,440円)

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,764,800,770
株式	73,755,053,530
未収入金	413,572,864
未収配当金	104,710,200
流動資産合計	77,038,137,364
資産合計	77,038,137,364
負債の部	
流動負債	
未払金	137,854,091
未払解約金	11,886,000
流動負債合計	149,740,091
負債合計	149,740,091
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	7,764,035,399
剰余金	

期末剰余金又は期末欠損金（△）	69,124,361,874
元本等合計	76,888,397,273
純資産合計	76,888,397,273
負債純資産合計	77,038,137,364

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	7,064,043,042円
期中追加設定元本額	1,110,393,659円
期中一部解約元本額	410,401,302円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	6,379,163,562円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,226,581円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	5,607,302円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	148,292,835円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	16,088,856円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	139,871,675円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	311,246,712円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	756,537,876円
計	7,764,035,399円
2. 期末日における受益権の総数	7,764,035,399口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2026年7月13日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	9.9031円
(1万口当たり純資産額)	(99,031円)

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	39,589,725
コール・ローン	46,875,838
株式	7,951,183,073
優先出資証券	1,976,381,221
投資証券	56,290,469
未収配当金	4,081,464
未収利息	6,720,016
流動資産合計	10,081,121,806
資産合計	10,081,121,806
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,996,000
その他未払費用	8,140
流動負債合計	3,004,140
負債合計	3,004,140
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	1,090,891,533
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,987,226,133
元本等合計	10,078,117,666
純資産合計	10,078,117,666
負債純資産合計	10,081,121,806

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13日
----	----------------------------

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	1,087,898,816円
期中追加設定元本額	23,589,501円
期中一部解約元本額	20,596,784円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,597,766円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,912,082円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	53,277,133円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	5,668,286円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	121,285,665円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	262,920,770円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	643,229,831円
計	1,090,891,533円
2. 期末日における受益権の総数	1,090,891,533口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2026年7月13日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	9.2384円
(1万口当たり純資産額)	(92,384円)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	130,842,871
コール・ローン	20,825,944
株式	2,437,660,904
未収配当金	2,056,647
流動資産合計	2,591,386,366
資産合計	2,591,386,366
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,748,000
その他未払費用	8,140
流動負債合計	1,756,140
負債合計	1,756,140
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	580,546,574
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,009,083,652
元本等合計	2,589,630,226
純資産合計	2,589,630,226
負債純資産合計	2,591,386,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13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	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	583,092,795円
期中追加設定元本額	26,763,771円

期中一部解約元本額	29,309,992円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	5,304,290円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	4,121,897円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	110,391,620円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	11,761,451円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	52,432,571円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	115,941,850円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	280,592,895円
計	580,546,574円
2. 期末日における受益権の総数	580,546,574口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2026年7月13日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	4.4607円

(1万口当たり純資産額)	(44,607円)
--------------	-----------

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	32,177,404
コール・ローン	4,524,479
株式	907,628,143
派生商品評価勘定	1,798
未収配当金	4,840,209
流動資産合計	949,172,033
資産合計	949,172,033
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,778,000
その他未払費用	8,140
流動負債合計	2,786,140
負債合計	2,786,140
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	90,763,332
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	855,622,561
元本等合計	946,385,893
純資産合計	946,385,893
負債純資産合計	949,172,033

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13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	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	133,760,334円
期中追加設定元本額	5,255,426円
期中一部解約元本額	48,252,428円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	2,239,452円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,647,568円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	46,134,352円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	4,913,923円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	3,669,943円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	9,729,356円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	22,428,738円
計	90,763,332円
2. 期末日における受益権の総数	90,763,332口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	600,000	-	598,723	1,277
アメリカ・ドル	600,000	-	598,723	1,277
買建	1,500,000	-	1,500,521	521
アメリカ・ドル	1,500,000	-	1,500,521	521
合計	2,100,000	-	2,099,244	1,798

(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)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	10.4270円

(1万口当たり純資産額)

(104,270円)

「ダイワ」－REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2026年7月13日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,691,690,569
投資証券 ※2	198,598,325,500
派生商品評価勘定	137,949,000
未収入金	204,663,664
未収配当金	1,841,918,944
流動資産合計	204,474,547,677
資産合計	204,474,547,677
負債の部	
流動負債	
前受金	135,030,000
未払金	323,508,590
流動負債合計	458,538,590
負債合計	458,538,590
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	51,061,844,284
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	152,954,164,803
元本等合計	204,016,009,087
純資産合計	204,016,009,087
負債純資産合計	204,474,547,677

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2026年1月14日 至2026年7月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年7月13日現在
1. ※1 期首	2026年1月14日
期首元本額	51,362,346,901円
期中追加設定元本額	5,863,596,089円
期中一部解約元本額	6,164,098,706円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ・J-REITファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	47,367,114,068円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,018,221円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,987,111円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	51,500,978円
6 資産バランスファンド（分配型）	56,603,585円
6 資産バランスファンド（成長型）	224,992,643円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	19,667,218円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	505,099,437円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	696,577,303円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	1,361,082,894円
DCダイワJ－REITアクティブファンド	182,165,525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）	50,686,166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）	14,645,468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）	71,254,848円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド（年4回決算型）	444,448,819円
計	51,061,844,284円
2. 期末日における受益権の総数	51,061,844,284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 658,500,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	3,650,220,000	-	3,788,400,000	138,180,000
合計	3,650,220,000	-	3,788,400,000	138,180,000

(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)

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	3.9955円
(1万口当たり純資産額)	(39,955円)

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2026年1月14日から2026年7月13日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	258,776,910
親投資信託受益証券	17,625,720,172
未収入金	7,313,000
流動資産合計	17,891,810,082
資産合計	17,891,810,082
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,248,420
未払受託者報酬	4,694,004
未払委託者報酬	93,881,032
その他未払費用	704,012
流動負債合計	108,527,468
負債合計	108,527,468
純資産の部	
元本等	
元本	※1 5,574,049,018
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	12,209,233,596
（分配準備積立金）	5,079,285,480
元本等合計	17,783,282,614
純資産合計	17,783,282,614
負債純資産合計	17,891,810,082

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2026年1月14日	
至 2026年7月13日	
営業収益	
受取利息	809,316
有価証券売買等損益	742,301,199
その他収益	21,901
営業収益合計	743,132,416
営業費用	
受託者報酬	4,694,004
委託者報酬	※ 1 93,881,032
その他費用	704,012
営業費用合計	99,279,048
営業利益又は営業損失（△）	643,853,368
経常利益又は経常損失（△）	643,853,368
中間純利益又は中間純損失（△）	643,853,368
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	10,736,260
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,324,539,234
剰余金増加額又は欠損金減少額	843,942,520
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	843,942,520
剰余金減少額又は欠損金増加額	592,365,266
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	592,365,266
中間剰余金又は中間欠損金（△）	12,209,233,596

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. ※1 期首元本額	5,459,134,609円
期中追加設定元本額	400,387,597円
期中一部解約元本額	285,473,188円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,574,049,018口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	14,050,983円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2026年7月13日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1904円 (31,904円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2026年1月14日から2026年7月13日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	461,529,168
親投資信託受益証券	29,054,477,772
未収入金	7,357,000
流動資産合計	29,523,363,940
資産合計	29,523,363,940
負債の部	
流動負債	
未払解約金	23,583,950
未払受託者報酬	7,703,539
未払委託者報酬	177,182,335
その他未払費用	1,090,735
流動負債合計	209,560,559
負債合計	209,560,559
純資産の部	
元本等	
元本	※1 7,070,524,538
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	22,243,278,843
（分配準備積立金）	9,392,588,265
元本等合計	29,313,803,381
純資産合計	29,313,803,381
負債純資産合計	29,523,363,940

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2026年1月14日	
至 2026年7月13日	
営業収益	
受取利息	1,363,076
有価証券売買等損益	1,790,091,966
その他収益	107,254
営業収益合計	1,791,562,296
営業費用	
受託者報酬	7,703,539
委託者報酬	※ 1 177,182,335
その他費用	1,090,735
営業費用合計	185,976,609
営業利益又は営業損失（△）	1,605,585,687
経常利益又は経常損失（△）	1,605,585,687
中間純利益又は中間純損失（△）	1,605,585,687
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	31,939,824
期首剰余金又は期首欠損金（△）	20,553,662,882
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,266,095,137
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,266,095,137
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,150,125,039
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,150,125,039
中間剰余金又は中間欠損金（△）	22,243,278,843

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. ※1 期首元本額	7,041,299,468円
期中追加設定元本額	423,082,167円
期中一部解約元本額	393,857,097円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	7,070,524,538口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2026年1月14日 至2026年7月13日
※1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	30,776,393円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2026年7月13日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4,1459円 (41,459円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

2【ファンドの現況】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

【純資産額計算書】

2026年6月30日

I	資産総額	13,813,373,360円
II	負債総額	64,064,369円
III	純資産総額（I－II）	13,749,308,991円
IV	発行済数量	5,286,747,083口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.6007円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	425,699,698,581円
II	負債総額	180,006,079円
III	純資産総額（I－II）	425,519,692,502円
IV	発行済数量	100,455,950,799口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	4.2359円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	127,501,524,696円
II	負債総額	261,282,508円
III	純資産総額（I－II）	127,240,242,188円
IV	発行済数量	116,867,174,522口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0888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

2026年6月30日

I	資産総額	99,336,610,727円
II	負債総額	344,043,722円
III	純資産総額（I－II）	98,992,567,005円
IV	発行済数量	16,758,665,936口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	5.9069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**

2026年6月30日

I	資産総額	203,450,764,572円
II	負債総額	3,413,821,206円
III	純資産総額（I－II）	200,036,943,366円
IV	発行済数量	50,586,562,550口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	3.9543円

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド**純資産額計算書**

2026年6月30日

I	資産総額	9,991,731,160円
II	負債総額	25,598,323円
III	純資産総額（I－II）	9,966,132,837円
IV	発行済数量	1,092,756,434口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	9.1202円

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド**純資産額計算書**

2026年6月30日

I	資産総額	2,589,730,669円
II	負債総額	1,281,000円
III	純資産総額（I－II）	2,588,449,669円

IV	発行済数量	583,505,571口
V	1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.4360円

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	1,043,090,347円
II	負債総額	3,702,608円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,039,387,739円
IV	発行済数量	98,738,316口
V	1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	10.5267円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	75,976,987,453円
II	負債総額	188,976,023円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	75,788,011,430円
IV	発行済数量	7,724,290,985口
V	1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.8116円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	17,857,657,864円
II	負債総額	105,835,781円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,751,822,083円
IV	発行済数量	5,567,503,403口
V	1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1885円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

純資産額計算書

2026年6月30日

I	資産総額	29,394,138,025円
II	負債総額	197,097,923円
III	純資産総額（I－II）	29,197,040,102円
IV	発行済数量	7,068,809,215口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	4.1304円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）」の記載と同じ。

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

- ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2026年6月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

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

b. 委託会社の機構

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審議・決定します。

ロ. 商品本部長

商品本部長は、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

運用チームまたは運用チームの戦略における基本的な運用方針を審議・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。

2026年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	68	391,445
追加型株式投資信託	765	45,091,288
株式投資信託 合計	833	45,482,733
単位型公社債投資信託	66	130,695
追加型公社債投資信託	14	1,503,746
公社債投資信託 合計	80	1,634,441
総合計	913	47,117,174

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(2025年4月1日から2026年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	13,153	7,798
有価証券	1,194	652
前払費用	513	717
未収委託者報酬	19,097	23,971
未収収益	110	230
関係会社短期貸付金	70,000	52,400
金銭の信託	-	18,993
その他	94	404
流動資産計	104,164	105,168
固定資産		
有形固定資産	※ 1 61	※ 1 55
建物	0	0
器具備品	59	52
建設仮勘定	0	2
無形固定資産	1,160	1,262
ソフトウェア	1,062	1,167
ソフトウェア仮勘定	97	94
その他	0	1
投資その他の資産	14,856	21,090
投資有価証券	9,348	13,401
関係会社株式	3,414	5,586
出資金	34	34
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	995	1,007

その他	13	9
固定資産計	16,077	22,408
資産合計	120,241	127,577

(単位:百万円)

	前事業年度 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	134	148
未払金	6,757	8,109
未払収益分配金	62	80
未払償還金	12	12
未払手数料	6,660	7,935
その他未払金	22	79
未払費用	5,997	7,290
未払法人税等	4,121	4,925
未払消費税等	763	1,437
賞与引当金	1,456	1,738
その他	0	1
流動負債計	19,233	23,651
固定負債		
退職給付引当金	2,300	2,323
役員退職慰労引当金	58	25
固定負債計	2,358	2,348
負債合計	21,592	25,999
純資産の部		
株主資本		
資本金	41,424	41,424
資本剰余金		
資本準備金	37,745	37,745
資本剰余金合計	37,745	37,745
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	17,743	20,341
利益剰余金合計	18,117	20,715
株主資本合計	97,287	99,886

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,361	1,691
評価・換算差額等合計	1,361	1,691
純資産合計	98,649	101,577
負債・純資産合計	120,241	127,577

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	91,634	104,615
その他営業収益	1,233	3,205
営業収益計	92,868	107,820
営業費用		
支払手数料	37,180	41,200
広告宣伝費	1,124	1,129
調査費	13,135	15,770
調査費	1,954	2,312
委託調査費	11,180	13,457
委託計算費	1,957	2,120
営業雑経費	3,114	4,313
通信費	167	165
印刷費	483	472
協会費	57	61
諸会費	18	20
その他営業雑経費	2,388	3,593
営業費用計	56,512	64,534
一般管理費		
給料	7,599	8,495
役員報酬	453	422
給料・手当	5,116	5,773
賞与	572	561
賞与引当金繰入額	1,456	1,738
福利厚生費	1,070	1,132
交際費	108	116
旅費交通費	247	284
租税公課	1,004	1,061
不動産賃借料	1,298	1,318
退職給付費用	349	393

役員退職慰労引当金繰入額	6	7
固定資産減価償却費	444	452
諸経費	2,164	2,777
一般管理費計	14,293	16,042
営業利益	22,061	27,243

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	387	383
有価証券償還益	183	294
受取利息	95	247
受取配当金	959	23
雑収入	76	157
営業外収益計	1,703	1,106
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,006
投資有価証券売却損	176	80
有価証券償還損	4	59
その他	54	24
営業外費用計	235	1,171
経常利益	23,528	27,179
特別利益		
投資有価証券売却益	※ 1 380	-
固定資産売却益	※ 2 110	-
特別利益計	491	-
特別損失		
固定資産売却損	※ 3 101	-
投資有価証券評価損	-	3
特別損失計	101	3
税引前当期純利益	23,918	27,175
法人税、住民税及び事業税	7,763	8,215
法人税等調整額	△ 397	△ 188
法人税等合計	7,366	8,026
当期純利益	16,552	19,149

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当期変動額						
新株の発行	26,250	26,250	-	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	-	△ 11,858	△ 11,858	△ 11,858
当期純利益	-	-	-	16,552	16,552	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	26,250	26,250	-	4,694	4,694	57,195
当期末残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287

	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	1,530	1,530	41,623
当期変動額			
新株の発行	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	△ 11,858
当期純利益	-	-	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 168	△ 168	△ 168
当期変動額合計	△ 168	△ 168	57,026
当期末残高	1,361	1,361	98,649

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)

	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	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287
当期変動額						
新株の発行	-	-	-	-	-	-
剰余金の配当	-	-	-	△ 16,551	△ 16,551	△ 16,551
当期純利益	-	-	-	19,149	19,149	19,149
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,598	2,598	2,598
当期末残高	41,424	37,745	374	20,341	20,715	99,886

	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	1,361	1,361	98,649
当期変動額			
新株の発行	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△ 16,551
当期純利益	-	-	19,149
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	329	329	329
当期変動額合計	329	329	2,927
当期末残高	1,691	1,691	101,577

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. 金銭の信託

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

4. 引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

（3）役員退職慰労引当金

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

5. 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。

（未適用の会計基準等）

リースに関する会計基準等

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

(1)概要

IFRS第16号の主要な定めを採り入れた新リース会計基準であります。借手の会計処理として、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

(2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「雑収入」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映するため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた76百万円は、「雑収入」76百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
建物	40百万円	41百万円
器具備品	269百万円	281百万円

2 保証債務

前事業年度(2025年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,341百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2026年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,598百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

※1 投資有価証券売却益の項目

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
投資有価証券売却益		
非上場株式	380百万円	一百万円

※2 固定資産売却益の項目

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
固定資産売却益		
美術品	83百万円	一百万円
ゴルフ会員権	26百万円	一百万円

※3 固定資産売却損の項目

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
固定資産売却損		
美術品	85百万円	一百万円
ゴルフ会員権	15百万円	一百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	652	—	3,260
合 計	2,608	652	—	3,260

2024年10月1日付で株式会社かんぼ生命保険より第三者割当増資に係る払込を受け、株式を発行しております。

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
2024年6月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 3月31日	2024年 6月20日

(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

2025年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- | | |
|-------------|------------|
| ① 剰余金の配当の総額 | 16,551百万円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1株当たり配当額 | 5,076円 |
| ④ 基準日 | 2025年3月31日 |
| ⑤ 効力発生日 | 2025年6月20日 |

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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	3,260	—	—	3,260
合 計	3,260	—	—	3,260

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
2025年6月19日 定時株主総会	普通株式	16,551	5,076	2025年 3月31日	2025年 6月20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

2026年6月17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 | 19,146百万円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1株当たり配当額 | 5,872円 |
| ④ 基準日 | 2026年3月31日 |
| ⑤ 効力発生日 | 2026年6月18日 |

(リース取引関係)

前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 1,037百万円	1年内 1,040百万円
1年超 7,521百万円	1年超 6,511百万円
合計 8,559百万円	合計 7,552百万円

（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。金銭の信託を通じて保有している証券投資信託につきましては、事業推進目的で保有しており、価格変動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。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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(2025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	2,230	7,968	—	10,199
金銭の信託	—	—	—	—
資産合計	2,230	7,968	—	10,199

当事業年度(2026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	4,710	9,001	—	13,711
金銭の信託	—	18,993	—	18,993
資産合計	4,710	27,995	—	32,705

(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

市場で取得した株式及び上場投資信託は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託のうちレベル1の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における無調整の相場価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としていることから、その時価をレベル2に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸等の取引先金融機関が提供する価格に基づき算定する資産の価格は、活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価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	342	342
子会社株式	1,386	3,558
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(2025年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,386百万円)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(2026年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 3,558百万円)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(2025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	120	55	65
(2)その他	7,230	5,161	2,068
小計	7,350	5,216	2,134
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,848	3,020	△172
小計	2,848	3,020	△172
合計	10,199	8,236	1,962

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 342百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2026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	133	55	78
(2)その他	7,886	4,756	3,130
小計	8,020	4,811	3,208
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	5,691	6,430	△739
小計	5,691	6,430	△739
合計	13,711	11,242	2,469

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 342百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	704	380	-
(2)その他 証券投資信託	3,039	387	176
合計	3,744	767	176

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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	2,479	383	80
合計	2,479	383	80

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、証券投資信託について3百万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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,227百万円	2,300百万円
勤務費用	149	172
退職給付の支払額	△ 166	△ 246
その他	89	97
退職給付債務の期末残高	2,300	2,323

(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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,300百万円	2,323百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,300	2,323
退職給付引当金	2,300	2,323

貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,300	2,323
-------------------------	-------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
勤務費用	149百万円	172百万円
その他	8	10
確定給付制度に係る退職給付費用	158	182

(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191百万円、当事業年度211百万円であります。

(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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	724	732
賞与引当金	340	434
未払事業税	260	323
株式報酬費用	150	136
関係会社株式評価損	87	87
投資有価証券評価損	171	31
出資金評価損	14	14
その他	157	395
繰延税金資産小計	1,907	2,155
評価性引当額	△ 277	△ 136
繰延税金資産合計	1,629	2,018
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 633	△ 1,011
繰延税金負債合計	△ 633	△ 1,011
繰延税金資産の純額	995	1,007

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(2025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(2026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. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和7年法律第13号）が2025年3月31日に国会で成立し、2026年4月1日以後に開始する事業年度から防衛特別法人税の創設に伴う法人税率等の引上げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.62%から2026年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については31.52%となります。

この税率変更により、繰延税金資産が27百万円増加、法人税等調整額が27百万円減少しております。

（企業結合等関係）

（取得による企業結合）

当社は、2025年6月19日開催の当社取締役会において、投資商品の開発・運用・助言サービスを提供する三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社を子会社化するための資金拠出を行うことを決議し、2025年7月1日付で同社の株式を取得いたしました。

1. 企業結合の概要

（1）被取得企業の名称及び事業内容

名称：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社

事業内容：投資商品開発・運用・助言事業

（2）企業結合を行った主な理由

オルタナティブ投資に関わる知見やゲートキーパー機能を獲得することで、同領域におけるビジネス展開の足掛かりとするとともに、本件を契機により付加価値の高い事業領域への本格参入に向けて探索を進めるためです。

（3）企業結合日

2025年7月1日（株式取得日）

2025年6月30日（みなし取得日）

（4）企業結合の法的形式

現金による株式の取得

（5）結合後企業の名称

大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社

（6）取得した議決権比率

51%

（7）取得企業を決定するに至った主な根拠

当社が現金を対価として株式を取得したためです。

2. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

現金 2,142百万円

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

アドバイザー費用等 30百万円

(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104,615百万円、その他3,205百万円であります。

(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5. 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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持株 会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸 付	63,600	関係会 社 短期貸 付金	70,000
								貸付の回 収	17,000	—	—
								利息の受 取 (注1)	89	—	—
その他 の 関係会 社	(株)かんぽ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保険 業	被所有 20.0	あり	投資顧問 契約の締 結	投資顧問 報酬 (注2)	215	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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。

(注2) 投資顧問報酬については市場実勢を勘案して合理的に決定しております。

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持株 会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸 付 貸付の回 収 利息の受 取 (注1)	20,800 38,400 236	関係会 社 短期貸 付金 — —	52,400 — —
その他の 関係会 社	(株)かんぼ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保険 業	被所有 20.0	あり	投資顧問 契約の締 結	投資顧問 報酬 (注2)	1,492	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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。

(注2) 投資顧問報酬については市場実勢を勘案して合理的に決定しております。

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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				
子会 社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	経営管 理	債務保証 (注)	2,341	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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 (%)	関係内容		取引の内容 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				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	なし	経営管理	債務保証 (注)	2,598	—	—

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 2024年4月1日 至 2025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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任 等	事業上 の関係				
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	—	なし	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)	15,779	未払手数料	3,657
							本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注3)	1,038	長期差入保証金	1,037
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	—	なし	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守 (注4)	857	未払費用	77

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任 等	事業上 の関係				
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	—	なし	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)	16,682	未払手 数料	4,134
							本社ビル の管理	不動産の 賃借料 (注3)	1,045	長期差 入保証 金	1,037
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	—	なし	ソフト ウェアの 開発・保 守	ソフト ウェアの 購入・保 守 (注4)	912	未払費 用	82

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)		当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)	
1株当たり純資産額	30,254.44円	1株当たり純資産額	31,152.40円
1株当たり当期純利益	5,642.31円	1株当たり当期純利益	5,872.86円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益(百万円)	16,552	19,149
普通株式の期中平均株式数(株)	2,933,697	3,260,657

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2025年7月1日、株式譲渡取引により大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化いたしました。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	① 名 称	② 資本金の額 (2025年03月末日現在)	③ 事業の内容	④ 備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	株式会社三井住友銀行	1,771,093百万円	(注3)	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	株式会社りそな銀行	279,928百万円	(注6)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912千ユーロ	(注13)	
	コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	582千米ドル	(注13)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
 - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
 - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
 - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
 - ① 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ② 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
 - ・ 使用開始日を記載することがあります。
 - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ① 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ② 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
 - ・ 次の事項を記載することがあります。
 - ① 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ② 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ③ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
 - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
 - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
 - ・ 図案を採用することがあります。
 - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
 - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
 - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用することがあります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2026年5月25日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

渡部 啓太

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

松田 好弘

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2025年4月1日から2026年3月31日までの第67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2026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（社会的影響度の高い事業体の財務諸表監査に適用される規定を含む。）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。

独立監査人の監査報告書

2026年3月13日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2025年1月11日から2026年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2026年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2026年3月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2025年1月11日から2026年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2026年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2026年3月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2025年1月11日から2026年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2026年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年9月11日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松田 好弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2026年1月14日から2026年7月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）の2026年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2026年1月14日から2026年7月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年9月11日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松田 好弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2026年1月14日から2026年7月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2026年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2026年1月14日から2026年7月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年9月11日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松田 好弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2026年1月14日から2026年7月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2026年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2026年1月14日から2026年7月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。