【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年11月30日提出
【計算期間】	６資産バランスファンド（分配型） 第29特定期間 （自　2020年3月7日　至　2020年9月7日） ６資産バランスファンド（成長型） 第29計算期間 （自　2020年3月7日　至　2020年9月7日）
【ファンド名】	６資産バランスファンド（分配型） ６資産バランスファンド（成長型）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【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】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

６資産バランスファンド（分配型）

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	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）））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

６資産バランスファンド（成長型）

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	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）））
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

※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

・「追加型投信」…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

・「内外」…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、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

・「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

（注2）属性区分の定義

・「その他資産」…組入れている資産

・「資産複合　資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの

・「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

・「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

・「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

・「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

・「為替ヘッジなし」…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

商品分類表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈6資産バランスファンド（分配型）〉

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	年1回	グローバル（含む日本）	ファミリーファンド	あり（　　）
一般	年2回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	なし
大型株	年4回	北米		
中小型株	年6回（隔月）	欧州		
債券	年12回（毎月）	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他（　）	中南米		
社債		アフリカ		
その他債券		中近東（中東）		
クレジット属性（　　）		エマージング		
不動産投信				
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））				
資産複合（　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表〈6資産バランスファンド（成長型）〉

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 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）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （含む日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　　） なし

（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。

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

＜信託金の限度額＞

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

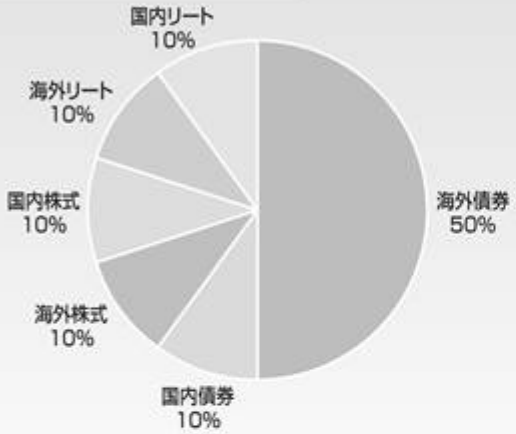
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の債券、株式およびリートに投資します。

●６資産バランスファンド（分配型）、６資産バランスファンド（成長型）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。

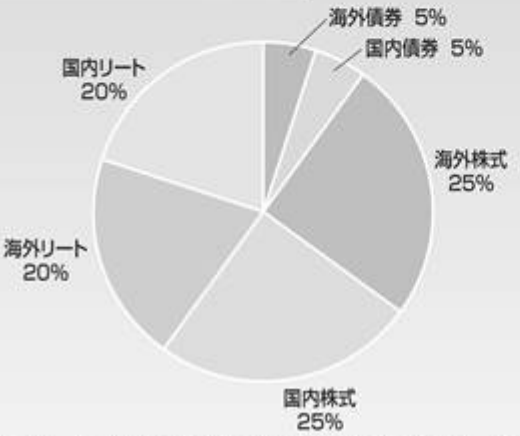
〈6資産バランスファンド(分配型)〉



	組入比率	海外	国内
債　券	60%	50%	10%
株　式	20%	10%	10%
リート	20%	10%	10%
合　計	100%	70%	30%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

〈6資産バランスファンド(成長型)〉



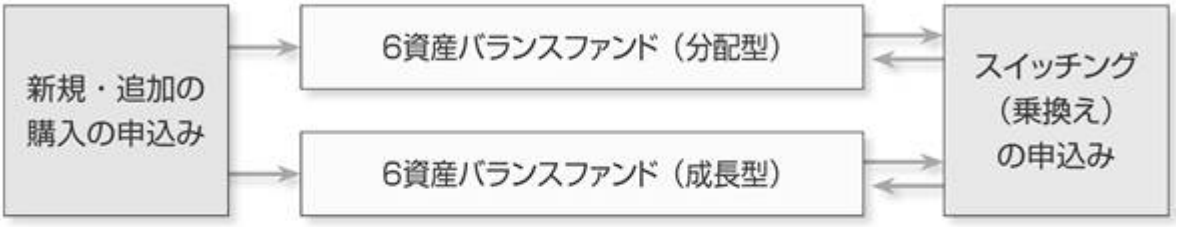
	組入比率	海外	国内
債　券	10%	5%	5%
株　式	50%	25%	25%
リート	40%	20%	20%
合　計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

2 「6資産バランスファンド（分配型）」、「6資産バランスファンド（成長型）」の2つのファンドがあります。

●2つのファンドは、資産配分比率と収益分配の時期・方針が異なります。

◆投資者のみなさまのご判断により、各ファンド間のスイッチング（乗換え）ができます。



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。

3 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

●ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度　欧州通貨圏：50%程度

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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて

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

※1　ムーディーズでA3以上またはS&PでA−以上

※2　ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上

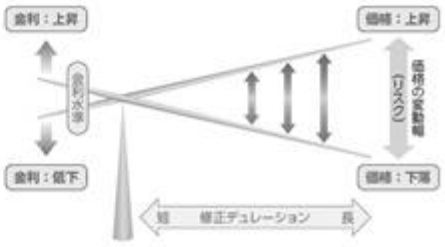
●ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

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

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

金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ）



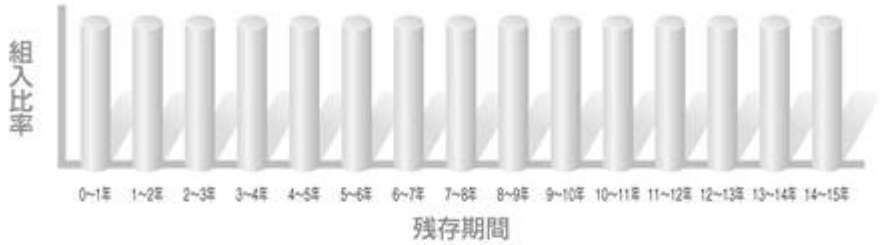
●金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

4 わが国の債券への投資にあたっては、国債に投資します。

●残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

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

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

・ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
・運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、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、ダイワ日本国債マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

●ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

イ．持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。

ロ．株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

〈海外の株式〉

銘柄選定にあたっては、ドイツのイーコム・リサーチ・アーゲーの調査情報を参考にします。

◇イーコム・リサーチは、世界的な調査・格付会社の一つであり、環境への取組みを含めた企業責任の格付け（Corporate Responsibility格付け）等を行なっています。

◇イーコム・リサーチの企業責任の格付けは、環境的側面と社会的・文化的側面において行なわれ、それらをベースとした総合格付けが行なわれます。

（委託会社に対してダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドの運用にかかる投資助言を行なうものではありません。）

〈わが国の株式〉

銘柄選定にあたっては、株式会社日本総合研究所の調査情報を参考にします。

◇日本総合研究所は、1969年に設立された日本を代表するシンクタンクです。

◇日本総合研究所は、企業の「社会的責任」（社会的側面、環境的側面）の調査を行ないます。なお、日本総合研究所は、投資助言・代理業の登録を行なっておらず、有価証券の価値等または有価証券の価値等の分析に基づく投資判断の助言を行なうものではありません。

6 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。
- リート運用では最大級の資産規模。
- ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- 優先リートを含むハイブリッド証券などのインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- 所在地：アメリカ合衆国　ニューヨーク州　ニューヨーク

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

投資対象銘柄の業種（イメージ）

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

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

7 2つのファンドは、それぞれ毎月または年2回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

■6資産バランスファンド（分配型）

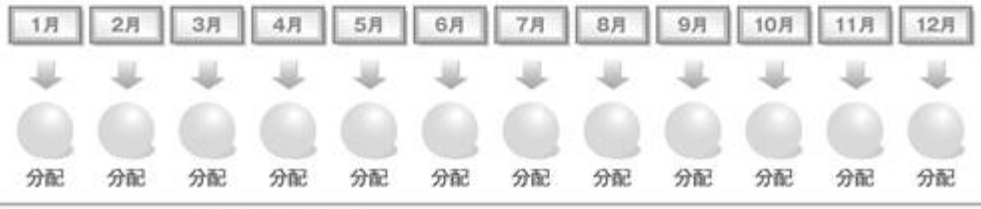
毎月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。なお、3月と9月の計算期末について、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



■6資産バランスファンド（成長型）

毎年3月6日および9月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②原則として、配当等収益等を中心に分配を行ないます。ただし、基準価額の水準等によっては売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ

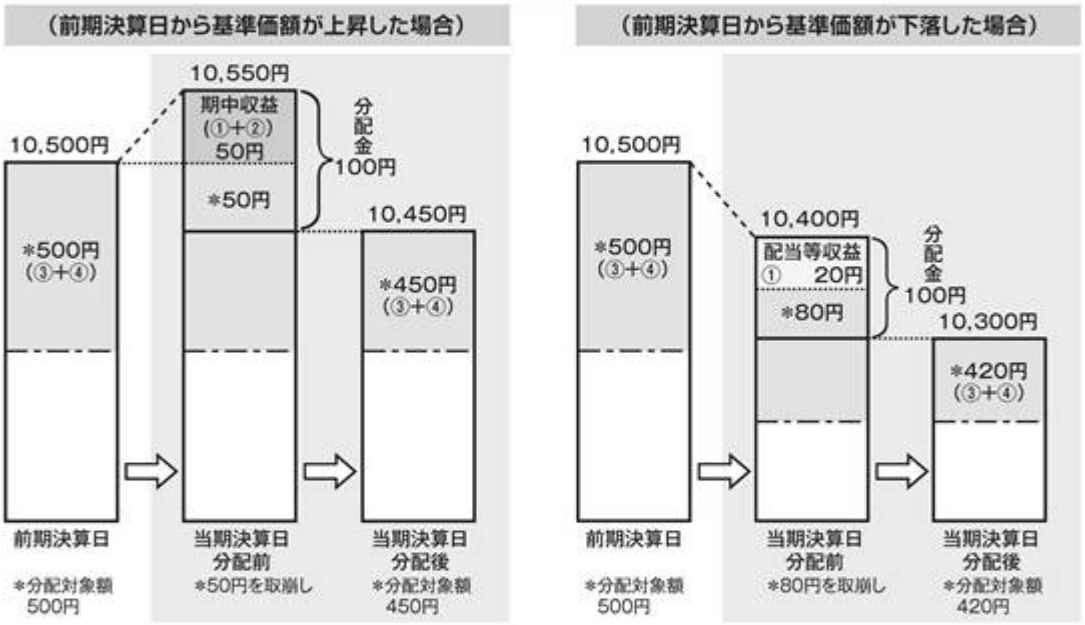
- 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

［収益分配金に関する留意事項］

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

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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

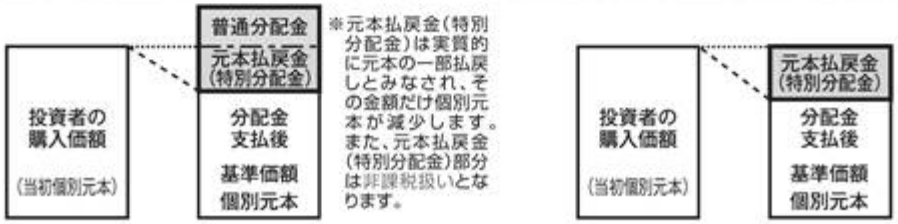


(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）　（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金） … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006年3月14日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金（※5）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※5）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※5）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	内外の公社債、不動産投資信託証券および株式　など ・ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 ・なお、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」における外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します。

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。
（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（※3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、同マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（※4）。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。

※4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
※5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社等の概況（2020年9月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

＜各ファンド共通＞

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券

6. ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券

② 投資態度

＜６資産バランスファンド（分配型）＞

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の50%
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%
ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%
ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の10%

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

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

＜６資産バランスファンド（成長型）＞

イ．（６資産バランスファンド（分配型）と同規定）

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

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の20%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の20%
ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の25%
ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の25%

ハ．～ニ．（６資産バランスファンド（分配型）と同規定）

(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。）

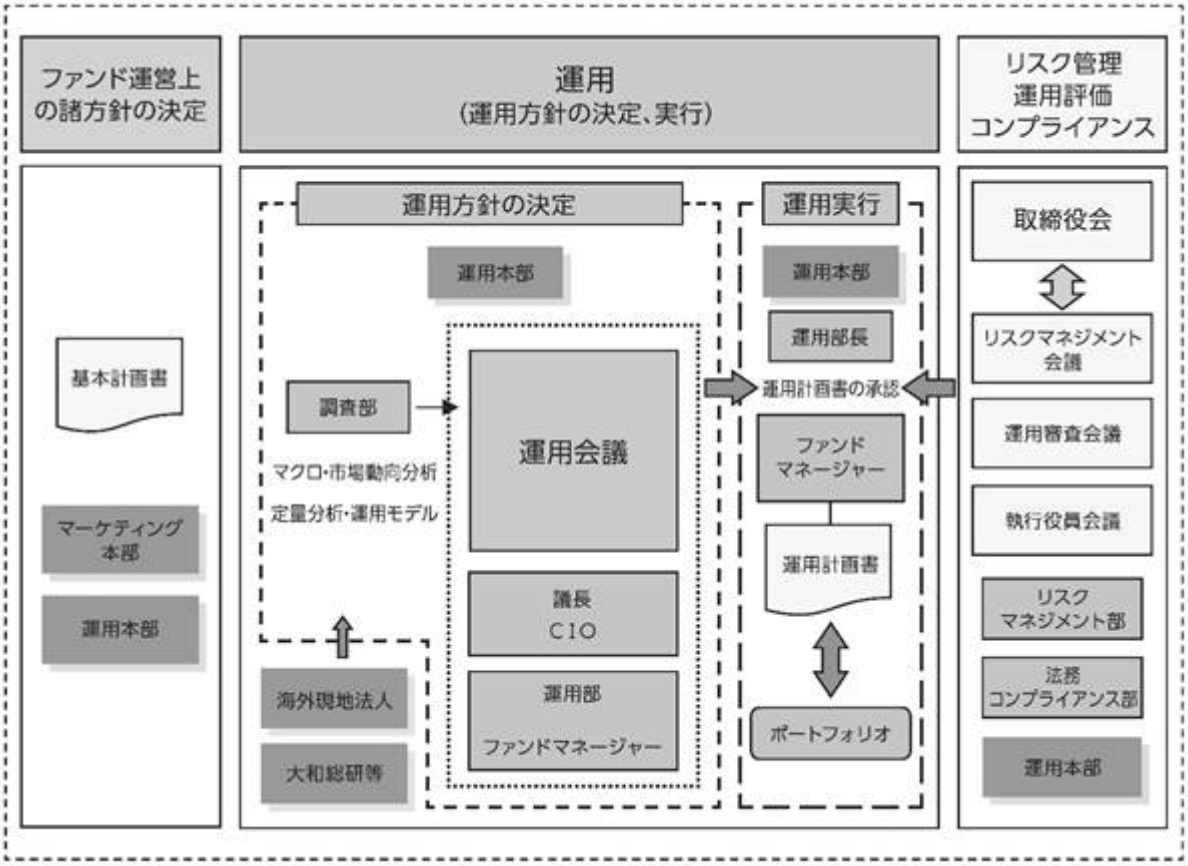
③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③　職務権限（委託会社）

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）（2名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

イ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ロ．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。

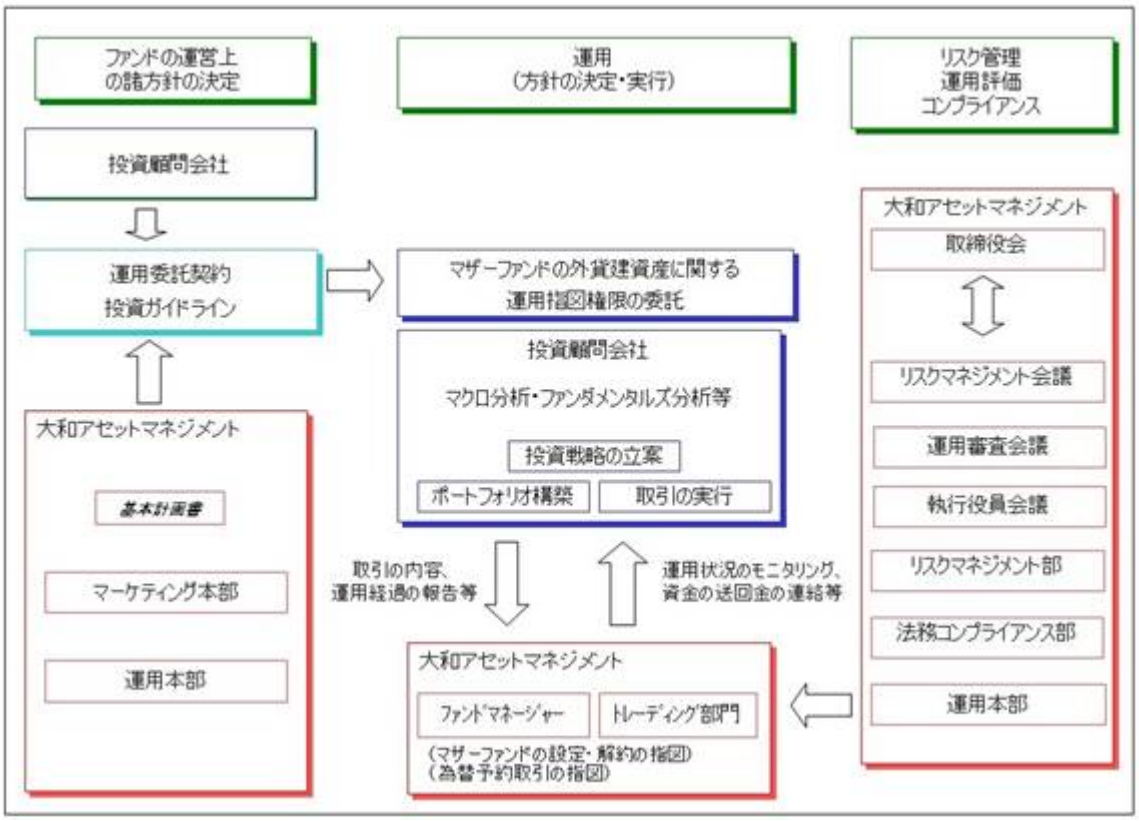
ハ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※海外リートにかかる運用体制について（マザーファンドにかかるものを含みます。）



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前④に同じ。）

※　上記の運用体制は2020年9月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

＜６資産バランスファンド（分配型）＞

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。なお、3月と9月の計算期末について、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

＜６資産バランスファンド（成長型）＞

①　（６資産バランスファンド（分配型）と同規定）

②　原則として、配当等収益等を中心に分配を行ないます。ただし、基準価額の水準等によっては売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　（６資産バランスファンド（分配型）と同規定）

(5)　【投資制限】

＜各ファンド共通＞

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑥　資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コー

ル市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2．ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

2. （ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

2.～16. （ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

③ (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

(3) 主な投資制限

① 株式

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

② 投資信託証券

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

イ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ロ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ．と同規定)

⑤ スワップ取引

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

ロ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ハ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

ホ．(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

3．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．約束手形
ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。
② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク
New York，New York，USA

② 前①の規定にかかわらず、前①により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。
② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
④ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
⑤ 先物取引

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

1. 先物取引の売建の指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

－

5. ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ. 主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ. ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

(a) 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。
(b) 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

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

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの⑤と同規定）

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの⑥と同規定）

6. ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ．（ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドと同規定）

ハ．株式の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。

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

(2) 投資対象

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

1. （ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドと同規定）

2. （ダイワ外国ハーモニーストック・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. 株券または新株引受権証書

2. ～10.（ダイワ外国ハーモニーストック・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.（ダイワ外国ハーモニーストック・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 （ダイワ外国ハーモニーストック・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. （ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドと同規定）

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

3. （ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドと同規定）

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

1. （ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドのハ．と同規定）
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. （ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドのハ．と同規定）

④　スワップ取引

（ダイワ日本国債マザーファンドの⑤と同規定）

⑤　金利先渡取引

（ダイワ日本国債マザーファンドの⑥と同規定）

3　【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑤　その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 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、お買付けの申込みの受付けを中止することがあります。

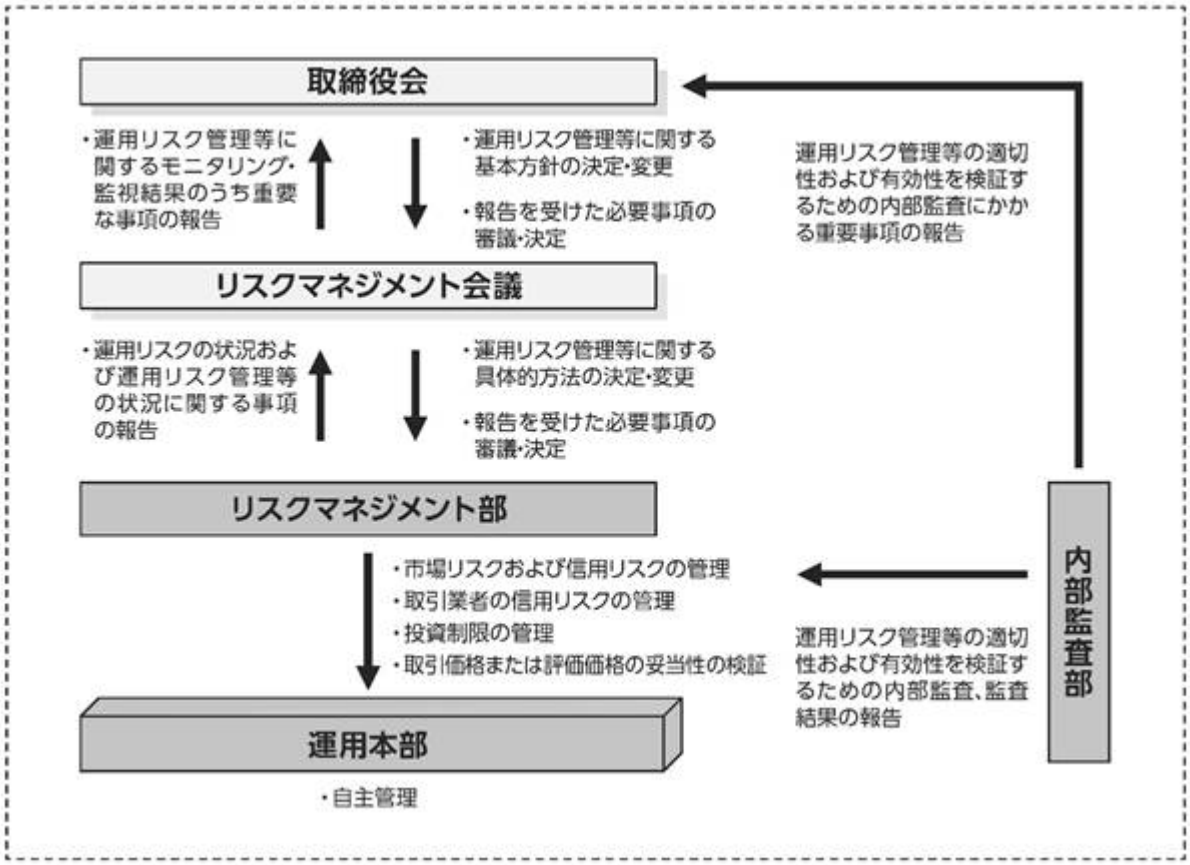
② 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(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。

(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

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

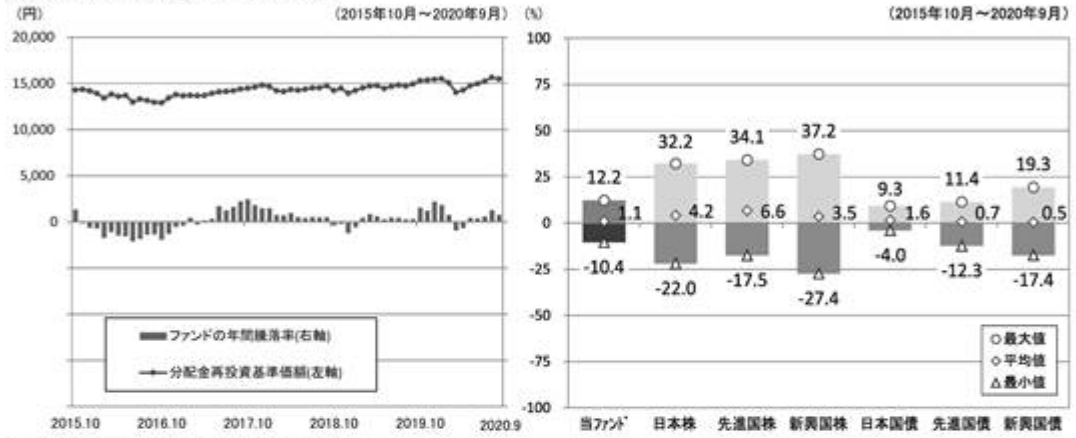
参　考　情　報

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

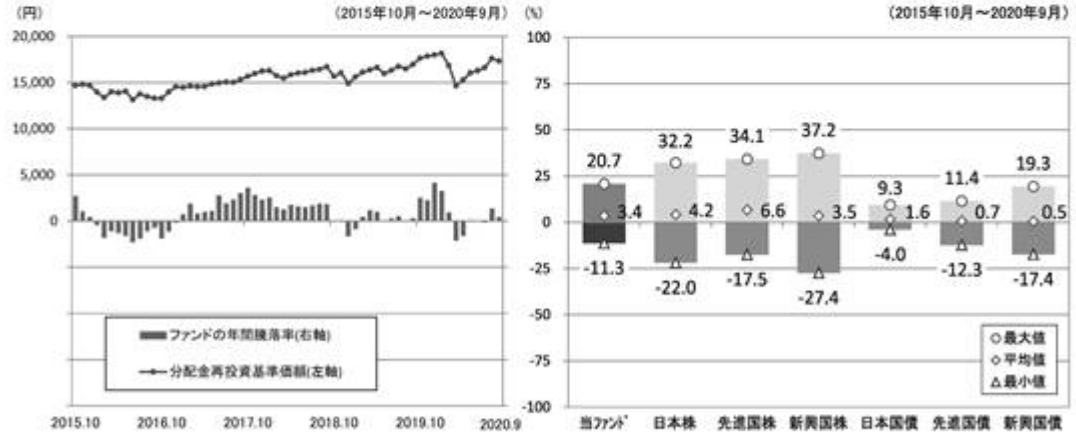
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[6資産バランスファンド（分配型）]



[6資産バランスファンド（成長型）]



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

※資産クラスについて

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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●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.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

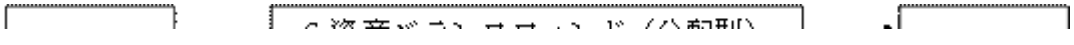
① 販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

＜スイッチング（乗換え）について＞

・「６資産バランスファンド（分配型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「６資産バランスファンド（成長型）」の受益権の取得申込みを行なうこと、および「６資産バランスファンド（成長型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「６資産バランスファンド（分配型）」の受益権の取得申込みを行なうことをいいます。
・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
・スイッチング（乗換え）にかかる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、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

（６資産バランスファンドの構成）



② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

(2) 【換金(解約)手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に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、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。

６資産バランスファンド（分配型）	年率1.4025%（税抜1.275%）
６資産バランスファンド（成長型）	年率1.485%（税抜1.35%）

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。

イ．委託会社

計算期間を通じて毎日、信託報酬の総額からロ．およびハ．を除いた額とします。

ロ．販売会社

各販売会社ごとに、計算期間を通じて毎日、次の額を当該各販売会社にかかる各ファンドごとの取扱純資産総額により按分して得た額とします。

当該各販売会社にかかる「６資産バランスファンド（分配型）」および「６資産バランスファンド（成長型）」の取扱純資産総額の合計額に次の率を乗じて得た額	
200億円以下の部分	年率0.60%（税抜）
200億円超500億円以下の部分	年率0.70%（税抜）
500億円超1,000億円以下の部分	年率0.75%（税抜）
1,000億円超2,000億円以下の部分	年率0.80%（税抜）
2,000億円超の部分	年率0.85%（税抜）

ハ．受託会社

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.05%（税抜）を乗じて得た額とします。

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

⑤ 委託会社は、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次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。

275億円以下の部分	年率0.57%
275億円超 1,000億円以下の部分	年率0.47%
1,000億円超 2,500億円以下の部分	年率0.37%
2,500億円超 4,500億円以下の部分	年率0.30%
4,500億円超の部分	年率0.25%

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間120万円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5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円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5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

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

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

①　投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

②　投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

＜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、2020年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

－

【６資産バランスファンド（分配型）】

－

(1) 【投資状況】 (2020年9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	3,181,144,481	99.18
内 日本	3,181,144,481	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	26,325,304	0.82
純資産総額	3,207,469,785	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】 (2020年9月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	872,393,210	1.8393 1,604,592,831	1.8157 1,584,004,351	49.38
2	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	249,564,762	1.2717 317,371,516	1.3168 328,626,878	10.25
3	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	117,094,741	2.7579 322,935,587	2.7904 326,741,165	10.19
4	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	121,969,709	2.7127 330,867,232	2.6448 322,585,486	10.06
5	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	129,309,929	2.5029 323,660,357	2.4230 313,317,957	9.77

6	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	242,387,388	1.2591 305,198,833	1.2619 305,868,644	9.54

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.18%
合計	99.18%

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

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10特定期間末 (2011年3月7日)	13,192,319,236	13,247,845,915	0.7128	0.7158
第11特定期間末 (2011年9月6日)	10,253,334,035	10,300,272,065	0.6553	0.6583
第12特定期間末 (2012年3月6日)	8,804,587,261	8,843,335,825	0.6817	0.6847
第13特定期間末 (2012年9月6日)	7,353,035,794	7,386,696,493	0.6553	0.6583
第14特定期間末 (2013年3月6日)	7,853,337,755	7,883,145,301	0.7904	0.7934
第15特定期間末 (2013年9月6日)	7,074,659,739	7,101,480,676	0.7913	0.7943
第16特定期間末 (2014年3月6日)	6,877,725,989	6,902,007,680	0.8497	0.8527

第17特定期間末 (2014年9月8日)	6,552,698,709	6,574,968,184	0.8827	0.8857
第18特定期間末 (2015年3月6日)	6,497,082,056	6,517,407,029	0.9590	0.9620
第19特定期間末 (2015年9月7日)	5,616,843,895	5,635,979,094	0.8806	0.8836
第20特定期間末 (2016年3月7日)	5,340,361,399	5,359,077,440	0.8560	0.8590
第21特定期間末 (2016年9月6日)	4,871,209,952	4,883,041,173	0.8235	0.8255
第22特定期間末 (2017年3月6日)	4,550,527,870	4,555,893,297	0.8481	0.8491
第23特定期間末 (2017年9月6日)	4,255,400,522	4,260,338,209	0.8618	0.8628
第24特定期間末 (2018年3月6日)	3,850,378,563	3,854,887,804	0.8539	0.8549
第25特定期間末 (2018年9月6日)	3,753,345,912	3,757,646,453	0.8728	0.8738
第26特定期間末 (2019年3月6日)	3,510,785,296	3,514,809,795	0.8724	0.8734
第27特定期間末 (2019年9月6日)	3,386,980,185	3,390,813,789	0.8835	0.8845
2019年9月末日	3,409,459,911	―	0.8893	―
10月末日	3,458,066,319	―	0.9107	―
11月末日	3,444,907,710	―	0.9121	―
12月末日	3,390,206,375	―	0.9170	―
2020年1月末日	3,393,093,157	―	0.9193	―
2月末日	3,275,828,157	―	0.8922	―
第28特定期間末 (2020年3月6日)	3,240,733,640	3,244,395,433	0.8850	0.8860
3月末日	3,027,615,697	―	0.8306	―
4月末日	3,070,626,253	―	0.8437	―
5月末日	3,166,336,037	―	0.8703	―
6月末日	3,182,720,431	―	0.8823	―
7月末日	3,224,993,282	―	0.8965	―
8月末日	3,263,986,883	―	0.9206	―
第29特定期間末 (2020年9月7日)	3,243,380,523	3,246,916,508	0.9172	0.9182
9月末日	3,207,469,785	―	0.9098	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10特定期間	0.0180
第11特定期間	0.0180
第12特定期間	0.0180
第13特定期間	0.0180
第14特定期間	0.0180
第15特定期間	0.0180
第16特定期間	0.0180
第17特定期間	0.0180
第18特定期間	0.0180
第19特定期間	0.0180
第20特定期間	0.0180
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0070
第23特定期間	0.0060
第24特定期間	0.0060
第25特定期間	0.0060
第26特定期間	0.0060
第27特定期間	0.0060
第28特定期間	0.0060
第29特定期間	0.0060

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第10特定期間	5.6
第11特定期間	△5.5
第12特定期間	6.8
第13特定期間	△1.2
第14特定期間	23.4
第15特定期間	2.4
第16特定期間	9.7
第17特定期間	6.0
第18特定期間	10.7
第19特定期間	△6.3
第20特定期間	△0.7

第21特定期間	△2.4
第22特定期間	3.8
第23特定期間	2.3
第24特定期間	△0.2
第25特定期間	2.9
第26特定期間	0.6
第27特定期間	2.0
第28特定期間	0.8
第29特定期間	4.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第10特定期間	196,858,150	4,157,148,141
第11特定期間	165,066,849	3,027,949,891
第12特定期間	144,609,379	2,874,431,384
第13特定期間	130,223,333	1,826,178,206
第14特定期間	135,935,916	1,420,320,121
第15特定期間	144,301,373	1,139,837,825
第16特定期間	104,178,267	950,593,513
第17特定期間	98,111,594	768,850,258
第18特定期間	186,967,235	835,134,645
第19特定期間	154,515,343	551,106,835
第20特定期間	174,195,213	313,914,543
第21特定期間	48,758,118	371,827,750
第22特定期間	33,814,915	583,997,839
第23特定期間	22,728,218	450,468,059
第24特定期間	19,445,597	447,892,407
第25特定期間	16,237,604	224,937,155
第26特定期間	18,121,773	294,164,207
第27特定期間	19,336,644	210,231,574
第28特定期間	20,645,914	192,457,084
第29特定期間	20,006,959	145,814,734

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年9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		20,435,590,152	93.67
	内 ユーロ	5,327,227,423	24.42
	内 ノルウェー	293,306,038	1.34
	内 スウェーデン	351,707,955	1.61
	内 デンマーク	718,123,873	3.29
	内 イギリス	2,600,782,392	11.92
	内 ポーランド	1,477,254,611	6.77
	内 カナダ	1,969,237,398	9.03
	内 アメリカ	5,308,376,266	24.33
	内 オーストラリア	2,389,574,196	10.95
特殊債券		1,059,761,431	4.86
	内 カナダ	1,059,761,431	4.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		321,604,739	1.47
純資産総額		21,816,956,322	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）		2,298,228,000	10.53
	内 日本	2,298,228,000	10.53
為替予約取引（売建）		2,300,919,533	△10.55
	内 日本	2,300,919,533	△10.55

(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（2020年9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	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	19,000,000	141.60 2,030,997,303	142.16 2,039,029,439	4.500000 2033/04/21	9.35
2	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	11,186,000	109.01 1,514,180,870	112.28 1,559,627,825	1.950000 2026/04/30	7.15

3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,791,400	125.41 1,564,553,065	124.78 1,556,780,360	2.500000 2046/02/15	7.14
4	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	10,000,000	105.81 1,313,842,770	110.82 1,376,101,608	1.400000 2028/04/30	6.31
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	14,367,000	105.39 1,196,729,485	106.59 1,210,316,577	1.500000 2026/06/01	5.55
6	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	7,124,500	123.72 1,199,623,838	122.77 1,190,403,198	5.000000 2025/03/07	5.46
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,200,000	158.70 1,024,700,508	171.79 1,109,220,543	3.250000 2045/05/25	5.08
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,442,000	101.26 1,011,600,489	100.75 1,006,485,795	1.375000 2021/04/30	4.61
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,689,700	106.40 978,265,118	107.16 985,233,944	1.625000 2026/02/15	4.52
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	107.83 912,715,440	107.54 910,269,344	2.375000 2024/02/29	4.17
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,296,700	109.74 847,198,209	110.05 849,606,820	2.250000 2025/11/15	3.89
12	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	109.62 750,931,250	111.79 765,775,200	2.750000 2028/04/25	3.51
13	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,593,000	101.52 711,907,172	101.45 711,479,411	1.750000 2021/07/25	3.26
14	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,830,000	106.69 660,208,361	108.56 671,824,103	2.250000 2025/12/15	3.08
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	108.66 665,482,141	109.14 668,384,941	1.500000 2026/07/22	3.06
16	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	6,681,000	108.46 572,668,181	108.93 575,186,739	2.250000 2025/06/01	2.64
17	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	29,000,000	111.73 540,465,193	112.23 542,922,490	1.750000 2025/11/15	2.49
18	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	112.20 488,621,890	112.65 490,581,586	1.625000 2028/10/22	2.25
19	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	3,420,000	105.85 449,504,091	108.52 460,846,797	1.000000 2026/05/15	2.11

20	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	107.41 382,005,335	109.08 387,937,327	2.550000 2025/03/15	1.78
21	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	169.91 316,482,633	183.25 341,325,325	3.750000 2045/06/22	1.56
22	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	108.19 320,755,410	112.14 332,459,542	1.100000 2029/05/15	1.52
23	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	120.91 264,710,516	121.12 265,165,872	3.250000 2029/04/21	1.22
24	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	187.21 254,774,089	184.74 251,412,666	4.250000 2046/12/07	1.15
25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	110.27 247,666,420	109.62 246,208,766	3.000000 2024/03/14	1.13
26	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	147.07 174,345,316	154.99 183,734,080	3.500000 2045/12/01	0.84
27	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	107.86 181,281,834	107.86 181,280,650	1.000000 2026/11/12	0.83
28	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	5,500,000	183.16 168,037,405	190.97 175,201,382	4.500000 2039/11/15	0.80
29	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	106.47 171,386,688	105.87 170,427,305	1.500000 2023/11/13	0.78
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	695,000	165.44 142,777,700	171.08 147,645,778	2.500000 2046/08/15	0.68

(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	93.67%
特殊債券	4.86%
合計	98.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年10月	買建	26,500,000	2,029,315,677	2,000,220,000	9.17%
		ユーロ買/円売 2020年10月	買建	2,400,000	299,809,334	298,008,000	1.37%
		カナダ・ドル売/円買 2020年10月	売建	25,331,615	2,029,315,677	2,001,704,217	△9.17%
		米ドル売/円買 2020年10月	売建	2,828,657	299,809,334	299,215,316	△1.37%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年9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		189,127,058,770	99.27
	内 日本	189,127,058,770	99.27
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		1,382,882,885	0.73
純資産総額		190,509,941,655	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（2020年9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	48 20年国債	日本	国債証券	12,901,000,000	102.14 13,177,963,400	100.58 12,976,341,840	2.500000 2020/12/21	6.81
2	4 30年国債	日本	国債証券	9,900,000,000	130.94 12,963,844,000	128.93 12,764,961,000	2.900000 2030/11/20	6.70
3	54 20年国債	日本	国債証券	11,987,000,000	104.36 12,510,352,420	102.85 12,329,468,590	2.200000 2021/12/20	6.47
4	88 20年国債	日本	国債証券	6,060,000,000	116.44 7,056,627,600	113.89 6,902,279,400	2.300000 2026/06/20	3.62
5	116 20年国債	日本	国債証券	5,600,000,000	120.77 6,763,288,000	120.88 6,769,336,000	2.200000 2030/03/20	3.55
6	95 20年国債	日本	国債証券	5,805,000,000	119.16 6,917,617,500	116.27 6,749,531,550	2.300000 2027/06/20	3.54
7	20 30年国債	日本	国債証券	5,000,000,000	133.30 6,665,000,000	133.04 6,652,150,000	2.500000 2035/09/20	3.49
8	8 30年国債	日本	国債証券	5,500,000,000	120.88 6,648,840,000	120.10 6,605,830,000	1.800000 2032/11/22	3.47
9	6 30年国債	日本	国債証券	5,250,000,000	127.39 6,688,272,000	125.60 6,594,472,500	2.400000 2031/11/20	3.46
10	75 20年国債	日本	国債証券	5,874,000,000	110.88 6,513,650,000	109.99 6,460,930,080	2.100000 2025/03/20	3.39
11	12 30年国債	日本	国債証券	5,100,000,000	126.69 6,461,190,000	124.80 6,365,208,000	2.100000 2033/09/20	3.34
12	101 20年国債	日本	国債証券	5,360,000,000	121.60 6,517,760,000	118.71 6,363,124,000	2.400000 2028/03/20	3.34
13	80 20年国債	日本	国債証券	5,673,000,000	112.53 6,383,826,900	110.50 6,269,005,380	2.100000 2025/06/20	3.29
14	68 20年国債	日本	国債証券	5,725,000,000	108.83 6,230,628,000	108.11 6,189,354,750	2.200000 2024/03/20	3.25
15	16 30年国債	日本	国債証券	4,700,000,000	133.98 6,297,060,000	131.52 6,181,675,000	2.500000 2034/09/20	3.24
16	140 20年国債	日本	国債証券	5,200,000,000	119.53 6,215,612,000	118.71 6,173,128,000	1.700000 2032/09/20	3.24
17	15 30年国債	日本	国債証券	4,700,000,000	133.49 6,274,453,000	131.14 6,163,862,000	2.500000 2034/06/20	3.24
18	110 20年国債	日本	国債証券	5,200,000,000	118.68 6,171,464,000	118.27 6,150,456,000	2.100000 2029/03/20	3.23

19	1　30年国債	日本	国債証券	4,850,000,000	127.40 6,179,236,000	125.22 6,073,509,500	2.800000 2029/09/20	3.19
20	70　20年国債	日本	国債証券	5,438,000,000	111.00 6,036,367,900	109.45 5,951,945,380	2.400000 2024/06/20	3.12
21	94　20年国債	日本	国債証券	5,200,000,000	115.47 6,004,808,000	114.35 5,946,408,000	2.100000 2027/03/20	3.12
22	19　30年国債	日本	国債証券	4,400,000,000	130.31 5,733,816,000	129.74 5,708,780,000	2.300000 2035/06/20	3.00
23	86　20年国債	日本	国債証券	5,000,000,000	115.73 5,786,950,000	113.28 5,664,150,000	2.300000 2026/03/20	2.97
24	121　20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	118.73 5,342,985,000	118.64 5,339,115,000	1.900000 2030/09/20	2.80
25	64　20年国債	日本	国債証券	5,000,000,000	107.57 5,378,528,000	106.05 5,302,600,000	1.900000 2023/09/20	2.78
26	59　20年国債	日本	国債証券	4,295,000,000	104.59 4,492,274,500	104.08 4,470,407,800	1.700000 2022/12/20	2.35
27	102　20年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	122.08 3,662,400,000	119.25 3,577,770,000	2.400000 2028/06/20	1.88
28	63　20年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	105.79 3,173,880,000	105.27 3,158,340,000	1.800000 2023/06/20	1.66
29	106　20年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	119.38 2,387,720,000	118.19 2,363,860,000	2.200000 2028/09/20	1.24
30	111　20年国債	日本	国債証券	500,000,000	120.10 600,525,000	119.59 597,980,000	2.200000 2029/06/20	0.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.27%
合計	99.27%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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（2020年9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		68,673,865,258	95.87
	内 香港	2,241,449,806	3.13
	内 シンガポール	6,263,493,891	8.74
	内 イギリス	6,414,484,489	8.95
	内 オランダ	294,755,454	0.41
	内 ベルギー	3,446,089,145	4.81
	内 フランス	3,127,740,552	4.37
	内 ドイツ	842,190,791	1.18
	内 カナダ	1,077,117,913	1.50
	内 アメリカ	34,075,786,068	47.57
	内 オーストラリア	9,989,186,960	13.94
	内 ニュージーランド	901,570,189	1.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,961,160,237	4.13
純資産総額		71,635,025,495	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）		23,251,624	0.03
	内 日本	23,251,624	0.03
為替予約取引（売建）		23,258,436	△0.03
	内 日本	23,258,436	△0.03

(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（2020年9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	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	41,495	79,989.03 3,319,144,883	80,774.06 3,351,719,952	4.68
2	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,434,963	1,358.06 3,306,838,270	1,372.40 3,341,763,188	4.66
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	113,125	23,777.49 2,689,828,783	23,372.27 2,643,988,949	3.69
4	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	234,258	10,786.31 2,526,779,408	10,538.73 2,468,783,686	3.45
5	LINK REIT	香港	投資証券	2,637,892	868.14 2,290,059,561	849.71 2,241,449,806	3.13
6	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,245,912	930.03 2,088,780,810	945.13 2,122,689,589	2.96
7	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,621,327	1,279.24 2,074,076,079	1,267.27 2,054,659,196	2.87
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	345,875	6,360.69 2,200,005,729	5,766.10 1,994,349,838	2.78
9	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	501,985	4,009.82 2,012,869,493	3,910.36 1,962,946,080	2.74
10	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	11,577,990	154.75 1,791,746,053	166.83 1,931,589,648	2.70
11	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	5,959,777	309.20 1,842,763,048	316.15 1,884,225,217	2.63
12	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	265,731	7,200.95 1,913,538,709	6,770.14 1,799,036,604	2.51
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	357,776	4,811.78 1,721,540,832	4,504.96 1,611,768,000	2.25
14	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	7,045,541	228.03 1,606,629,942	226.48 1,595,737,536	2.23
15	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	639,094	2,624.89 1,677,556,562	2,474.66 1,581,541,636	2.21
16	UDR INC	アメリカ	投資証券	414,751	3,723.10 1,544,160,278	3,419.45 1,418,222,795	1.98
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	66,737	23,528.86 1,570,245,663	21,117.68 1,409,330,610	1.97
18	AEDIFICA	ベルギー	投資証券	105,501	12,739.84 1,344,066,071	12,690.17 1,338,826,047	1.87

19	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	1,887,139	751.18 1,417,581,074	683.46 1,289,799,118	1.80
20	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	109,064	11,778.71 1,284,633,664	11,345.99 1,237,439,271	1.73
21	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	シンガポール	投資証券	8,893,100	132.95 1,182,391,004	130.63 1,161,767,905	1.62
22	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	384,355	3,015.78 1,159,131,967	2,802.40 1,077,117,913	1.50
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	371,726	3,042.80 1,131,090,847	2,861.89 1,063,838,922	1.49
24	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	353,132	3,085.12 1,089,457,421	2,962.40 1,046,118,237	1.46
25	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	136,734	8,067.03 1,103,050,741	7,561.52 1,033,917,696	1.44
26	COFINIMMO	ベルギー	投資証券	61,923	15,546.08 962,660,160	15,670.25 970,349,138	1.35
27	GECINA SA	フランス	投資証券	70,153	13,857.37 972,136,218	13,497.27 946,874,614	1.32
28	KLEPIERRE	フランス	投資証券	681,451	1,649.59 1,124,120,513	1,359.66 926,542,689	1.29
29	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	6,490,724	140.78 913,821,568	140.41 911,371,644	1.27
30	GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド	投資証券	5,532,475	163.65 905,431,304	162.95 901,570,189	1.26

(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	95.87%
合計	95.87%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2020年10月	買建	219,790	23,259,535	23,251,624	0.03%
		英ポンド売/円買 2020年10月	売建	109,934	14,960,928	14,959,829	△0.02%
		ユーロ売/円買 2020年10月	売建	66,833	8,298,607	8,298,607	△0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年9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		83,726,040,640	96.38
	内 日本	83,726,040,640	96.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,147,166,018	3.62
純資産総額		86,873,206,658	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		2,062,200,000	2.37
	内 日本	2,062,200,000	2.37

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

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

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

(2) 投資資産（2020年9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	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	10,750	612,470.19 6,584,054,583	538,000.00 5,783,500,000	6.66
2	日本ビルファンド	日本	投資証券	8,758	667,111.35 5,842,561,262	596,000.00 5,219,768,000	6.01
3	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	18,280	262,902.51 4,805,857,906	269,000.00 4,917,320,000	5.66
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	35,998	130,801.71 4,708,600,276	132,000.00 4,751,736,000	5.47
5	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	13,202	320,831.06 4,235,611,749	311,000.00 4,105,822,000	4.73
6	ＧＬＰ投資法人	日本	投資証券	22,527	143,659.76 3,236,223,431	162,800.00 3,667,395,600	4.22
7	三井不ロジパーク	日本	投資証券	7,140	470,311.58 3,358,024,727	502,000.00 3,584,280,000	4.13
8	日本プロロジスリート	日本	投資証券	9,239	296,552.04 2,739,844,356	355,500.00 3,284,464,500	3.78
9	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	17,661	172,005.88 3,037,795,909	185,900.00 3,283,179,900	3.78
10	産業ファンド	日本	投資証券	18,185	169,454.70 3,081,533,728	180,300.00 3,278,755,500	3.77
11	日本リテールファンド	日本	投資証券	17,878	145,802.69 2,606,660,531	162,400.00 2,903,387,200	3.34
12	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	21,929	119,286.37 2,615,830,916	116,700.00 2,559,114,300	2.95
13	オリックス不動産投資	日本	投資証券	15,517	145,042.69 2,250,627,454	161,300.00 2,502,892,100	2.88
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	29,764	70,293.60 2,092,218,853	77,600.00 2,309,686,400	2.66
15	森ヒルズリート	日本	投資証券	16,484	140,012.17 2,307,960,751	136,900.00 2,256,659,600	2.60
16	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	16,229	121,861.21 1,977,685,673	122,900.00 1,994,544,100	2.30
17	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,875	324,425.33 1,905,998,836	326,500.00 1,918,187,500	2.21
18	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	2,825	604,231.67 1,706,954,485	629,000.00 1,776,925,000	2.05

19	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	12,492	132,757.76 1,658,410,009	139,300.00 1,740,135,600	2.00
20	イオンリート投資	日本	投資証券	12,394	116,355.85 1,442,114,476	121,100.00 1,500,913,400	1.73
21	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	27,195	42,028.05 1,142,953,026	51,700.00 1,405,981,500	1.62
22	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	7,898	179,351.30 1,416,516,636	176,200.00 1,391,627,600	1.60
23	東急リアル・エステート	日本	投資証券	9,197	139,540.26 1,283,351,861	146,800.00 1,350,119,600	1.55
24	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	1,950	635,000.00 1,238,250,000	604,000.00 1,177,800,000	1.36
25	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	2,609	406,154.05 1,059,655,922	434,000.00 1,132,306,000	1.30
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	9,103	118,085.56 1,074,932,907	122,300.00 1,113,296,900	1.28
27	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	35,621	30,907.79 1,100,966,647	31,200.00 1,111,375,200	1.28
28	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	3,322	316,928.85 1,052,837,667	307,000.00 1,019,854,000	1.17
29	SOSILA物流リート投	日本	投資証券	7,114	130,243.87 926,554,957	139,300.00 990,980,200	1.14
30	ザイマックス・リート	日本	投資証券	10,433	96,243.13 1,004,104,580	91,800.00 957,749,400	1.10

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.38%
合計	96.38%

(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	東証REIT指数先物 2020年12月	買建	1,200	2,049,612,000	2,062,200,000	2.37%

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

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

ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年9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		1,298,468,016	99.55
	内 中国	15,870,173	1.22
	内 香港	3,742,011	0.29
	内 デンマーク	11,104,293	0.85
	内 イギリス	20,575,521	1.58
	内 オランダ	17,632,667	1.35
	内 フランス	16,942,979	1.30
	内 ドイツ	34,148,465	2.62
	内 スイス	34,841,429	2.67
	内 イタリア	2,672,759	0.20
	内 カナダ	14,420,762	1.11
	内 アメリカ	1,124,201,841	86.19
	内 オーストラリア	2,315,116	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,852,735	0.45
純資産総額		1,304,320,751	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）		6,275,692	0.48
	内 日本	6,275,692	0.48
為替予約取引（売建）		6,280,785	△0.48
	内 日本	6,280,785	△0.48

(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（2020年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	6,840	12,797.56 87,535,365	12,070.72 82,563,738	6.33
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	3,025	22,667.65 68,569,641	21,928.10 66,332,527	5.09
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	185	348,570.79 64,485,597	332,728.30 61,554,736	4.72
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	1,425	29,912.83 42,625,788	27,697.38 39,468,769	3.03
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	200	168,332.03 33,666,406	155,455.11 31,091,023	2.38
6	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	495	53,418.42 26,442,118	55,971.37 27,705,830	2.12
7	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	725	28,731.78 20,830,549	28,789.23 20,872,198	1.60
8	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	400	51,975.41 20,790,166	51,771.11 20,708,446	1.59
9	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	755	26,772.26 20,213,112	26,180.21 19,766,059	1.52
10	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	535	35,444.05 18,962,571	35,573.13 19,031,627	1.46
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	805	21,653.02 17,430,688	21,100.75 16,986,105	1.30

12	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	360	43,656.35 15,716,310	45,953.17 16,543,142	1.27
13	SERVICENOW INC	アメリカ	株式	情報技術	315	47,647.03 15,008,814	51,628.28 16,262,909	1.25
14	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	2,300	7,070.70 16,262,610	6,900.07 15,870,173	1.22
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	1,090	14,596.16 15,909,823	14,522.10 15,829,098	1.21
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,000	15,720.82 15,720,822	15,558.94 15,558,948	1.19
17	ABBOTT LABORATORIES	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,380	11,040.86 15,236,400	11,129.10 15,358,161	1.18
18	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	640	22,651.67 14,497,089	23,136.34 14,807,260	1.14
19	STANLEY BLACK & DECKER INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	850	16,905.46 14,369,665	17,084.58 14,521,896	1.11
20	QUALCOMM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,150	12,269.62 14,110,070	12,418.80 14,281,625	1.09
21	DANAHER CORP	アメリカ	株式	ヘルスケア	625	21,222.21 13,263,937	22,324.85 13,953,036	1.07
22	LOWE'S COS INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	800	16,716.50 13,373,264	17,167.10 13,733,686	1.05
23	UNION PACIFIC CORP	アメリカ	株式	資本財・サービス	625	20,567.73 12,854,862	20,867.99 13,042,495	1.00
24	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	325	37,847.01 12,300,280	39,517.10 12,843,058	0.98
25	DEERE & CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	525	22,667.96 11,900,715	23,295.04 12,229,898	0.94
26	ILLINOIS TOOL WORKS	アメリカ	株式	資本財・サービス	550	20,519.16 11,285,594	20,469.12 11,258,019	0.86

27	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	890	12,461.13 11,090,408	12,619.88 11,231,700	0.86
28	WORKDAY INC-CLASS A	アメリカ	株式	情報技術	470	22,944.63 10,783,981	23,358.52 10,978,506	0.84
29	ASTRAZENECA PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	915	11,094.46 10,151,552	11,620.72 10,632,963	0.82
30	DR HORTON INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,350	7,529.25 10,164,633	7,831.31 10,572,277	0.81

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.55%
合計	99.55%

(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	0.11%
素材	1.26%
資本財・サービス	12.95%
一般消費財・サービス	15.08%
生活必需品	5.32%
ヘルスケア	14.32%
金融	5.19%
情報技術	34.88%
コミュニケーション・サービス	9.66%
公益事業	0.73%
その他	0.04%
合計	99.55%

(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	ユーロ買/円売 2020年10月	買建	50,541	6,281,378	6,275,692	0.48%
		米ドル売/円買 2020年10月	売建	59,370	6,281,378	6,280,785	△0.48%

(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。

ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

(1) 投資状況（2020年9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		1,328,387,650	98.19
	内 日本	1,328,387,650	98.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,441,120	1.81
純資産総額		1,352,828,770	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（2020年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日本電産	日本	株式	電気機器	9,500	8,896.00 84,512,000	9,805.00 93,147,500	6.89
2	テルモ	日本	株式	精密機器	21,000	4,295.00 90,195,000	4,180.00 87,780,000	6.49
3	任天堂	日本	株式	その他製品	1,300	58,950.00 76,635,000	59,660.00 77,558,000	5.73
4	積水化学	日本	株式	化学	39,200	1,685.00 66,052,000	1,677.00 65,738,400	4.86

5	旭 化 成	日本	株式	化学	62,000	930.25 57,675,617	914.70 56,711,400	4.19
6	第一三共	日本	株式	医薬品	17,100	3,098.00 52,975,800	3,229.00 55,215,900	4.08
7	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	3,600	14,476.44 52,115,189	14,740.00 53,064,000	3.92
8	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	7,500	6,966.00 52,245,000	6,932.00 51,990,000	3.84
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1,900	26,400.00 50,160,000	27,330.00 51,927,000	3.84
10	ディスコ	日本	株式	機械	2,000	23,610.00 47,220,000	25,410.00 50,820,000	3.76
11	三井不動産	日本	株式	不動産業	27,500	1,942.32 53,413,974	1,826.50 50,228,750	3.71
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	2,500	19,900.00 49,750,000	19,300.00 48,250,000	3.57
13	花 王	日本	株式	化学	6,000	7,860.00 47,160,000	7,887.00 47,322,000	3.50
14	日本ユニシス	日本	株式	情報･通信業	13,500	2,945.00 39,757,500	3,300.00 44,550,000	3.29
15	キーエンス	日本	株式	電気機器	900	43,470.00 39,123,000	48,980.00 44,082,000	3.26
16	HOYA	日本	株式	精密機器	3,600	10,500.00 37,800,000	11,860.00 42,696,000	3.16
17	信越化学	日本	株式	化学	3,100	13,490.00 41,819,000	13,685.00 42,423,500	3.14
18	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	5,100	8,198.00 41,809,800	8,032.00 40,963,200	3.03
19	ダイフク	日本	株式	機械	3,700	9,220.00 34,114,000	10,580.00 39,146,000	2.89
20	GMOペイメントゲートウェイ	日本	株式	情報･通信業	3,400	10,340.00 35,156,000	11,240.00 38,216,000	2.82
21	野村総合研究所	日本	株式	情報･通信業	12,000	2,764.00 33,168,000	3,095.00 37,140,000	2.75
22	SMC	日本	株式	機械	600	57,710.00 34,626,000	58,460.00 35,076,000	2.59
23	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	75,000	443.40 33,255,000	416.10 31,207,500	2.31
24	T D K	日本	株式	電気機器	2,400	11,350.00 27,240,000	11,410.00 27,384,000	2.02

25	村田製作所	日本	株式	電気機器	4,000	6,507.00 26,028,000	6,773.00 27,092,000	2.00
26	ニチレイ	日本	株式	食料品	9,500	2,704.00 25,688,000	2,783.00 26,438,500	1.95
27	東京海上HD	日本	株式	保険業	5,500	4,817.00 26,493,500	4,600.00 25,300,000	1.87
28	NTTデータ	日本	株式	情報･通信業	12,000	1,216.00 14,592,000	1,342.00 16,104,000	1.19
29	ヒロセ電機	日本	株式	電気機器	800	12,270.00 9,816,000	13,530.00 10,824,000	0.80
30	光通信	日本	株式	情報･通信業	400	24,550.00 9,820,000	24,980.00 9,992,000	0.74

(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	98.19%
合計	98.19%

(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
食料品	1.95%
化学	15.69%
医薬品	4.08%
機械	12.81%
電気機器	21.84%
輸送用機器	3.84%
精密機器	9.64%
その他製品	5.73%
情報・通信業	10.79%
銀行業	2.31%
保険業	1.87%
不動産業	3.71%
サービス業	3.92%
合計	98.19%

(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

●6資産バランスファンド(分配型)

2020年9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	9,098円
純資産総額	32億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.1%
3カ月間	3.5%
6カ月間	10.3%
1年間	3.7%
3年間	7.7%
5年間	11.5%
設定来	54.7%

※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:　120円　　設定来分配金合計額:　4,380円

決算期	第163期 19年10月	第164期 19年11月	第165期 19年12月	第166期 20年1月	第167期 20年2月	第168期 20年3月	第169期 20年4月	第170期 20年5月	第171期 20年6月	第172期 20年7月	第173期 20年8月	第174期 20年9月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	32	48.7%
国内株式	30	10.1%
国内リート・先物	50	10.1%
外国株式	174	10.0%
国内債券	31	9.5%
外国リート	64	9.4%
コール・ローン、その他		2.6%
合計	381	-

通貨別構成	比率
日本円	31.0%
米ドル	25.1%
ユーロ	14.6%
豪ドル	11.4%
英ポンド	7.0%
ポーランド・ズロチ	3.4%
カナダ・ドル	2.6%
デンマーク・クローネ	1.7%
シンガポール・ドル	0.9%
その他	2.3%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.0
最終利回り(%)	0.2
修正デュレーション	7.7
残存年数	9.0

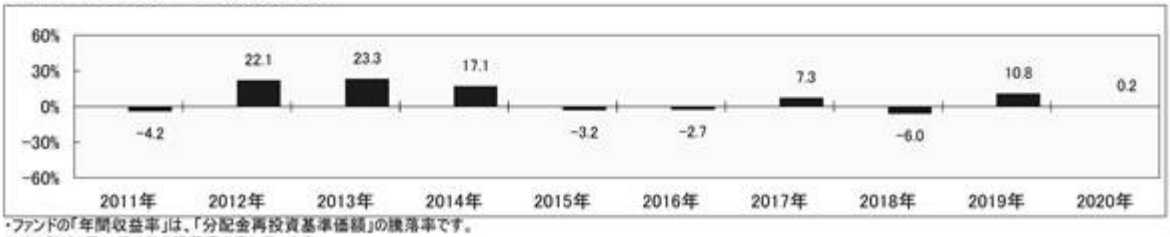
債券格付別構成	比率
AAA	79.7%
AA	14.5%
A	5.8%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	日本電産	日本	0.7%
株式	テルモ	日本	0.7%
株式	APPLE INC	アメリカ	0.6%
株式	任天堂	日本	0.6%
株式	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
リート	日本ビルファンド	日本	0.6%
リート	大和ハウスリート投資法人	日本	0.6%
リート	野村不動産マスターF	日本	0.6%
リート	アドバンス・レジデンス	日本	0.5%
合計			6.0%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2020年は9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。

【６資産バランスファンド（成長型）】

(1) 【投資状況】 (2020年9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		3,594,541,982	99.19
	内 日本	3,594,541,982	99.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		29,439,089	0.81
純資産総額		3,623,981,071	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】 (2020年9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	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	701,236,682	1.2717 891,762,736	1.3168 923,388,462	25.48
2	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	335,536,411	2.7114 909,805,708	2.6448 887,426,699	24.49
3	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	260,106,965	2.7580 717,395,434	2.7904 725,802,475	20.03
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	288,986,037	2.5031 723,384,244	2.4230 700,213,167	19.32
5	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	142,498,579	1.2591 179,419,962	1.2619 179,818,956	4.96
6	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	97,974,458	1.8393 180,204,426	1.8157 177,892,223	4.91

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.19%
合計	99.19%

(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10計算期間末 (2011年3月7日)	9,131,498,770	9,236,464,632	0.6960	0.7040
第11計算期間末 (2011年9月6日)	6,733,354,235	6,801,993,295	0.5886	0.5946
第12計算期間末 (2012年3月6日)	6,474,175,831	6,554,287,875	0.6465	0.6545
第13計算期間末 (2012年9月6日)	5,807,644,039	5,862,900,036	0.6306	0.6366
第14計算期間末 (2013年3月6日)	6,952,628,220	7,027,917,670	0.8311	0.8401
第15計算期間末 (2013年9月6日)	6,525,931,871	6,600,495,969	0.8752	0.8852
第16計算期間末 (2014年3月6日)	6,526,888,717	6,586,433,543	0.9865	0.9955
第17計算期間末 (2014年9月8日)	6,329,549,470	6,451,156,527	1.0410	1.0610
第18計算期間末 (2015年3月6日)	6,140,633,937	6,244,032,295	1.1878	1.2078

第19計算期間末 (2015年9月7日)	5,349,482,161	5,449,078,140	1.0742	1.0942
第20計算期間末 (2016年3月7日)	5,262,096,277	5,321,009,184	1.0718	1.0838
第21計算期間末 (2016年9月6日)	4,654,475,204	4,707,383,511	1.0557	1.0677
第22計算期間末 (2017年3月6日)	4,628,690,383	4,711,090,976	1.1235	1.1435
第23計算期間末 (2017年9月6日)	4,363,813,413	4,442,364,406	1.1111	1.1311
第24計算期間末 (2018年3月6日)	4,189,876,711	4,263,680,966	1.1354	1.1554
第25計算期間末 (2018年9月6日)	4,178,639,233	4,249,681,109	1.1764	1.1964
第26計算期間末 (2019年3月6日)	4,005,637,453	4,075,168,070	1.1522	1.1722
第27計算期間末 (2019年9月6日)	3,912,378,210	3,979,178,634	1.1714	1.1914
2019年9月末日	3,974,570,239	－	1.1856	－
10月末日	4,056,678,179	－	1.2330	－
11月末日	4,051,914,258	－	1.2479	－
12月末日	4,067,242,712	－	1.2585	－
2020年1月末日	4,078,790,093	－	1.2695	－
2月末日	3,768,574,831	－	1.1778	－
第28計算期間末 (2020年3月6日)	3,654,356,692	3,718,048,625	1.1475	1.1675
3月末日	3,182,723,166	－	1.0061	－
4月末日	3,315,579,037	－	1.0507	－
5月末日	3,481,289,488	－	1.1026	－
6月末日	3,521,445,168	－	1.1199	－
7月末日	3,573,501,488	－	1.1412	－
8月末日	3,755,822,974	－	1.2088	－
第29計算期間末 (2020年9月7日)	3,642,396,245	3,704,453,371	1.1739	1.1939
9月末日	3,623,981,071	－	1.1705	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0080

第11計算期間	0.0060
第12計算期間	0.0080
第13計算期間	0.0060
第14計算期間	0.0090
第15計算期間	0.0100
第16計算期間	0.0090
第17計算期間	0.0200
第18計算期間	0.0200
第19計算期間	0.0200
第20計算期間	0.0120
第21計算期間	0.0120
第22計算期間	0.0200
第23計算期間	0.0200
第24計算期間	0.0200
第25計算期間	0.0200
第26計算期間	0.0200
第27計算期間	0.0200
第28計算期間	0.0200
第29計算期間	0.0200

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第10計算期間	13.6
第11計算期間	△14.6
第12計算期間	11.2
第13計算期間	△1.5
第14計算期間	33.2
第15計算期間	6.5
第16計算期間	13.7
第17計算期間	7.6
第18計算期間	16.0
第19計算期間	△7.9
第20計算期間	0.9
第21計算期間	△0.4
第22計算期間	8.3
第23計算期間	0.7
第24計算期間	4.0

第25計算期間	5.4
第26計算期間	△0.4
第27計算期間	3.4
第28計算期間	△0.3
第29計算期間	4.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第10計算期間	135,224,757	2,331,510,666
第11計算期間	119,329,610	1,800,219,081
第12計算期間	87,768,441	1,513,606,314
第13計算期間	93,146,741	897,819,422
第14計算期間	83,650,617	927,488,897
第15計算期間	225,083,093	1,134,167,806
第16計算期間	134,423,918	974,741,916
第17計算期間	108,753,929	644,492,915
第18計算期間	184,379,112	1,094,814,032
第19計算期間	494,944,170	685,063,111
第20計算期間	159,604,753	229,994,788
第21計算期間	71,066,299	571,449,623
第22計算期間	72,368,248	361,364,208
第23計算期間	73,472,329	265,952,331
第24計算期間	72,412,106	309,748,996
第25計算期間	69,013,373	207,132,341
第26計算期間	89,085,587	164,648,508
第27計算期間	54,343,038	190,852,687
第28計算期間	59,843,886	215,268,440
第29計算期間	71,640,948	153,381,303

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

ダイワ日本国債マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●6資産バランスファンド(成長型)

2020年9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	11,705円
純資産総額	36億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.5%
3カ月間	6.3%
6カ月間	18.3%
1年間	2.2%
3年間	13.1%
5年間	25.8%
設定来	73.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額:　400円　　設定来分配金合計額:　3,860円

決算期	第18期 15年3月	第19期 15年9月	第20期 16年3月	第21期 16年9月	第22期 17年3月	第23期 17年9月	第24期 18年3月	第25期 18年9月	第26期 19年3月	第27期 19年9月	第28期 20年3月	第29期 20年9月
分配金	200円	200円	120円	120円	200円	200円	200円	200円	200円	200円	200円	200円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	30	25.0%
外国株式	174	24.4%
国内リート・先物	50	19.8%
外国リート	64	18.5%
国内債券	31	4.9%
外国債券	32	4.8%
コール・ローン、その他		3.0%
合計	381	-

通貨別構成	比率
日本円	51.5%
米ドル	32.0%
ユーロ	4.8%
豪ドル	3.7%
英ポンド	2.7%
シンガポール・ドル	1.7%
香港ドル	1.0%
カナダ・ドル	0.8%
スイス・フラン	0.7%
その他	1.1%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.0
最終利回り(%)	0.1
修正デュレーション	7.3
残存年数	8.4

債券格付別構成	比率
AAA	88.0%
AA	8.6%
A	3.4%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	日本電産	日本	1.8%
株式	テルモ	日本	1.7%
株式	APPLE INC	アメリカ	1.6%
株式	任天堂	日本	1.5%
株式	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.2%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	1.3%
リート	日本ビルファンド	日本	1.2%
リート	大和ハウスリート投資法人	日本	1.1%
リート	野村不動産マスターF	日本	1.1%
リート	アドバンス・レジデンス	日本	0.9%
	合計		13.4%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2020年は9月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

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

２ 【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

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、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

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

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

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

3　【資産管理等の概要】

(1)　【資産の評価】

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

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
・委託会社のホームページ
アドレス　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】

＜６資産バランスファンド（分配型）＞

毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年3月14日から2006年4月6日までとします。

＜６資産バランスファンド（成長型）＞

毎年3月7日から9月6日まで、および9月7日から翌年3月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年3月14日から2006年9月6日までとします。

＜各ファンド共通＞

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

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

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

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

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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

③　反対者の買取請求権

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

④　運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を「6資産バランスファンド（分配型）」については毎年3月および9月の計算期末、「6資産バランスファンド（成長型）」については毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

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

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥　関係法人との契約の更改

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

4　【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

②　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】

【６資産バランスファンド（分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年3月7日から2020年9月7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】

6資産バランスファンド（分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年3月6日現在	当　期 2020年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	5,308,901
コール・ローン	33,731,800	31,040,065
親投資信託受益証券	3,214,556,175	3,216,824,640
未収入金	－	5,000,000
流動資産合計	3,248,287,975	3,258,173,606
資産合計	3,248,287,975	3,258,173,606
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,661,793	3,535,985
未払解約金	－	7,101,504
未払受託者報酬	147,177	157,811
未払委託者報酬	3,605,868	3,866,523
その他未払費用	139,497	131,260
流動負債合計	7,554,335	14,793,083
負債合計	7,554,335	14,793,083
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,661,793,094	※1 3,535,985,319
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 421,059,454	※2 △ 292,604,796
（分配準備積立金）	38,543,888	43,082,343
元本等合計	3,240,733,640	3,243,380,523
純資産合計	3,240,733,640	3,243,380,523
負債純資産合計	3,248,287,975	3,258,173,606

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2019年9月7日 至　2020年3月6日	当　期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
営業収益		
受取利息	44	112
有価証券売買等損益	55,652,283	158,268,465
営業収益合計	55,652,327	158,268,577
営業費用		
支払利息	5,526	6,646
受託者報酬	928,306	875,478
委託者報酬	※1 22,744,708	※1 21,450,493
その他費用	139,517	131,374
営業費用合計	23,818,057	22,463,991
営業利益	31,834,270	135,804,586
経常利益	31,834,270	135,804,586
当期純利益	31,834,270	135,804,586
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	312,294	295,928
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 446,624,079	△ 421,059,454
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,396,123	17,096,542
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,396,123	17,096,542
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,921,776	2,520,317
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,921,776	2,520,317
分配金	※2 22,431,698	※2 21,630,225
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 421,059,454	△ 292,604,796

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2020年9月6日が休日のため、当特定期間末日を2020年9月7日としております。このため、当特定期間は185日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年3月6日現在	当　期 2020年9月7日現在
1．※1　期首元本額	3,833,604,264円	3,661,793,094円
期中追加設定元本額	20,645,914円	20,006,959円
期中一部解約元本額	192,457,084円	145,814,734円
2．特定期間末日における受益権の総数	3,661,793,094口	3,535,985,319口
3．※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は421,059,454円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は292,604,796円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2019年9月7日 至　2020年3月6日	当　期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7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	845,698円	818,185円
2．※2 分配金の計算過程	（自2019年9月7日　至2019年10月7日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,190,262円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,905,296円）及び分配準備積立金（36,832,020円）より分配対象額は62,927,578円（1万口当たり164.53円）であり、うち3,824,588円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年10月8日　至2019年11月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,474,876円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,778,619円）及び分配準備積立金（38,875,626円）より分配対象額は64,129,121円（1万口当たり168.96円）であり、うち3,795,450円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2020年3月7日　至2020年4月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,588,108円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,203,636円）及び分配準備積立金（38,306,998円）より分配対象額は63,098,742円（1万口当たり173.17円）であり、うち3,643,749円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2020年4月7日　至2020年5月7日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,248,714円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,201,702円）及び分配準備積立金（40,172,274円）より分配対象額は63,622,690円（1万口当たり174.85円）であり、うち3,638,727円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

	（自2019年11月7日　至2019年12月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,688,972円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,627,905円）及び分配準備積立金（40,174,801円）より分配対象額は61,491,678円（1万口当たり163.45円）であり、うち3,761,998円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2020年5月8日　至2020年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,189,037円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,110,887円）及び分配準備積立金（40,470,707円）より分配対象額は64,770,631円（1万口当たり179.21円）であり、うち3,614,231円（1万口当たり10円）を分配金額としております。
	（自2019年12月7日　至2020年1月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,860,518円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,330,221円）及び分配準備積立金（37,408,562円）より分配対象額は61,599,301円（1万口当たり166.61円）であり、うち3,697,178円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2020年6月9日　至2020年7月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,172,978円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,081,985円）及び分配準備積立金（41,901,983円）より分配対象額は63,156,946円（1万口当たり175.24円）であり、うち3,603,986円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

	（自2020年1月7日　至2020年2月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,789,266円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,371,017円）及び分配準備積立金（38,434,162円）より分配対象額は62,594,445円（1万口当たり169.60円）であり、うち3,690,691円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2020年7月7日　至2020年8月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,983,056円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,057,499円）及び分配準備積立金（40,324,084円）より分配対象額は64,364,639円（1万口当たり179.11円）であり、うち3,593,547円（1万口当たり10円）を分配金額としております。
	（自2020年2月7日　至2020年3月6日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,007,941円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,245,816円）及び分配準備積立金（39,197,740円）より分配対象額は61,451,497円（1万口当たり167.82円）であり、うち3,661,793円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2020年8月7日　至2020年9月7日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,633,896円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（18,816,674円）及び分配準備積立金（40,984,432円）より分配対象額は65,435,002円（1万口当たり185.05円）であり、うち3,535,985円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2020年9月7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

	前　期 2020年3月6日現在	当　期 2020年9月7日現在

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△136,832,186	35,697,704
合計	△136,832,186	35,697,704

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年3月6日現在	当　期 2020年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年3月6日現在	当　期 2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8850円 (8,850円)	0.9172円 (9,172円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	872,393,210	1,604,592,831	
	ダイワ日本国債マザーファンド	239,217,563	301,198,833	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	130,121,054	325,719,022	

	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	118,904,158	327,925,777	
	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	251,851,391	320,279,413	
	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	124,270,566	337,108,764	
親投資信託受益証券　合計			3,216,824,640	
合計			3,216,824,640	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	41,608,935	28,196,014
金銭信託	－	696,251
コール・ローン	74,004,056	4,070,841
国債証券	23,242,240,562	20,845,207,496
特殊債券	973,525,888	1,087,571,127

派生商品評価勘定	128,512,772	41,578,031
未収入金	－	451,631,302
未収利息	203,439,079	146,401,526
前払費用	13,015,194	1,651,480
差入委託証拠金	122,625,917	125,905,114
流動資産合計	24,798,972,403	22,732,909,182
資産合計	24,798,972,403	22,732,909,182
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	141,613,344	46,776,232
未払解約金	56,948,108	424,683,046
その他未払費用	－	27
流動負債合計	198,561,452	471,459,305
負債合計	198,561,452	471,459,305
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	14,107,340,049	12,103,202,664
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,493,070,902	10,158,247,213
元本等合計	24,600,410,951	22,261,449,877
純資産合計	24,600,410,951	22,261,449,877
負債純資産合計	24,798,972,403	22,732,909,182

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日
期首元本額	15,550,514,016円	14,107,340,049円
期中追加設定元本額	121,968,852円	178,438,767円
期中一部解約元本額	1,565,142,819円	2,182,576,152円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,540,752,333円	1,348,847,149円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型）	531,294,484円	－円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	804,131,234円	744,776,985円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	42,913,418円	37,034,117円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	153,733,918円	133,661,588円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	270,454,209円	246,101,368円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	402,100,109円	346,737,440円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	191,035,158円	176,525,849円
６資産バランスファンド（分配型）	956,020,059円	872,393,210円
６資産バランスファンド（成長型）	105,039,623円	99,615,166円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	5,908,374,675円	5,248,685,631円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	60,330,469円	51,359,696円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	225,587,136円	213,143,309円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	855,753,383円	747,508,490円
『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	20,027,744円	17,171,186円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	205,571,768円	188,988,072円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	871,147,467円	796,685,360円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	13,739,078円	19,695,124円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	691,623,474円	604,022,891円

	四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	257,710,310円	210,250,033円
	計	14,107,340,049円	12,103,202,664円
2.	期末日における受益権の総数	14,107,340,049口	12,103,202,664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　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年9月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	372,743,749	170,544,227
特殊債券	26,183,403	15,026,018
合計	398,927,152	185,570,245

（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（2019年10月11日から2020年3月6日まで、及び2020年4月11日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2020年3月6日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	2,397,629,344	－	2,269,116,572	128,512,772	2,760,261,969	－	2,806,556,201	△46,294,232
アメリカ・ドル	－	－	－	－	299,461,063	－	299,968,768	△507,705
イギリス・ポンド	－	－	－	－	141,147,000	－	140,920,000	227,000
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	116,490,000	－	116,235,000	255,000

カナダ･ドル	2,092,022,778	－	1,968,071,298	123,951,480	2,015,015,906	－	2,060,627,433	△45,611,527
スウェーデン･クローナ	305,606,566	－	301,045,274	4,561,292	－	－	－	－
ユーロ	－	－	－	－	188,148,000	－	188,805,000	△657,000
買 建	2,397,629,344	－	2,256,016,000	△141,613,344	2,314,476,969	－	2,355,573,000	41,096,031
オーストラリア･ドル	2,092,022,778	－	1,963,920,000	△128,102,778	2,015,015,906	－	2,053,485,000	38,469,094
ノルウェー･クローネ	305,606,566	－	292,096,000	△13,510,566	－	－	－	－
ユーロ	－	－	－	－	299,461,063	－	302,088,000	2,626,937
合計	4,795,258,688	－	4,525,132,572	△13,100,572	5,074,738,938	－	5,162,129,201	△5,198,201

（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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.7438円	1.8393円
（1万口当たり純資産額）	(17,438円)	(18,393円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	7,296,700.000	8,016,081.650	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	8,689,700.000	9,283,032.710	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	11,791,400.000	14,494,106.790	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	9,442,000.000	9,519,424.400	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	8,000,000.000	8,599,360.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 49,912,005.550 (5,308,640,910)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,903,740.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	3,590,112.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	7,124,500.000	8,753,374.430	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,812,400.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 19,059,626.430 (2,686,073,153)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,332,000.000	1,690,760.880	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	3,487,453.000	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	26,766,440.000	

オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 31,944,653.880 (2,475,710,676)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 2,313,705.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	6,681,000.000	7,277,078.820	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	14,367,000.000	15,285,051.300	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 24,875,835.120 (2,023,151,671)	
スウェーデン・クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	スウェーデン・クローナ 13,630,000.000	スウェーデン・クローナ 14,433,761.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	15,313,045.300	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 29,746,806.400 (362,316,102)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,500,000.000	デンマーク・クローネ 10,375,035.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	29,000,000.000	32,554,240.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 42,929,275.000 (726,363,333)	
ノルウェー・クローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	ノルウェー・クローネ 4,000,000.000	ノルウェー・クローネ 4,194,160.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,919,000.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 26,113,160.000 (311,007,735)	

	ポーランド・ズロチ	1.75% Poland Government Bond 20210725	ポーランド・ズロチ 28,593,000.000	ポーランド・ズロチ 29,039,050.800	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	27,718,500.000	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 56,757,550.800 (1,603,400,810)	
	ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	ユーロ 695,000.000	ユーロ 1,168,851.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	8,742,396.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,678,625.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	3,420,000.000	3,709,263.600	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,667,187.960	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	11,186,000.000	12,521,272.820	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	11,005,000.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 42,492,596.380 (5,348,543,106)	
国債証券　合計				20,845,207,496 [20,845,207,496]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 4,500,000.000	カナダ・ドル 4,894,470.000	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,830,000.000	8,477,854.200	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 13,372,324.200 (1,087,571,127)	
特殊債券　合計				1,087,571,127 [1,087,571,127]	
合計				21,932,778,623 [21,932,778,623]	

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

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 5銘柄	100%	24.2%
イギリス・ポンド	国債証券 4銘柄	100%	12.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄 特殊債券 2銘柄	100%	14.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	1.7%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	3.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	1.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	7.3%
ユーロ	国債証券 7銘柄	100%	24.4%

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。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	―	96,864,219
コール・ローン	534,107,043	566,345,403
国債証券	206,062,117,740	190,028,132,780
未収利息	1,241,584,841	1,147,257,599
前払費用	11,681,614	82,272,019
流動資産合計	207,849,491,238	191,920,872,020
資産合計	207,849,491,238	191,920,872,020
負債の部		

流動負債		
未払解約金	168,785,504	59,525,343
その他未払費用	－	663
流動負債合計	168,785,504	59,526,006
負債合計	168,785,504	59,526,006
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	162,834,008,365	152,377,013,850
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	44,846,697,369	39,484,332,164
元本等合計	207,680,705,734	191,861,346,014
純資産合計	207,680,705,734	191,861,346,014
負債純資産合計	207,849,491,238	191,920,872,020

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日
期首元本額	172,402,060,399円	162,834,008,365円
期中追加設定元本額	2,139,094,430円	859,854,785円
期中一部解約元本額	11,707,146,464円	11,316,849,300円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	4,055,796円	4,037,395円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	212,959,068円	194,678,263円
６資産バランスファンド（分配型）	261,312,434円	239,217,563円
６資産バランスファンド（成長型）	144,087,092円	144,877,457円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	150,926,836,706円	141,409,829,442円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	81,004,476円	69,107,073円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	42,936,530円	35,832,457円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	10,952,253,724円	10,079,456,162円
ダイワ・ニッポン応援ファンドVol.4 －日本の真価－（国債コース）	208,562,539円	199,978,038円
計	162,834,008,365円	152,377,013,850円
2. 期末日における受益権の総数	162,834,008,365口	152,377,013,850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　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年9月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,996,041,220	△2,948,364,440
合計	△1,996,041,220	△2,948,364,440

（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（2019年3月12日から2020年3月6日まで、及び2020年3月11日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年3月6日現在	2020年9月7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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2754円 (12,754円)	1.2591円 (12,591円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	１ ３０年国債	10,450,000,000	13,069,397,000	
	４ ３０年国債	9,900,000,000	12,743,874,000	
	６ ３０年国債	9,850,000,000	12,345,497,500	
	８ ３０年国債	5,500,000,000	6,583,775,000	
	１２ ３０年国債	5,100,000,000	6,342,870,000	
	１５ ３０年国債	4,700,000,000	6,141,490,000	
	１６ ３０年国債	5,300,000,000	6,944,908,000	
	１９ ３０年国債	4,400,000,000	5,685,680,000	
	４８ ２０年国債	12,901,000,000	12,998,015,520	
	５４ ２０年国債	11,987,000,000	12,347,209,350	
	５６ ２０年国債	300,000,000	311,433,000	
	５９ ２０年国債	9,095,000,000	9,474,807,200	
	６３ ２０年国債	3,000,000,000	3,160,710,000	
	６４ ２０年国債	5,000,000,000	5,307,400,000	
	６８ ２０年国債	2,225,000,000	2,407,494,500	
	７０ ２０年国債	4,438,000,000	4,861,829,000	
	７５ ２０年国債	5,874,000,000	6,461,869,920	
	８０ ２０年国債	5,673,000,000	6,267,984,240	
	８６ ２０年国債	5,000,000,000	5,660,800,000	
	８８ ２０年国債	6,060,000,000	6,897,613,200	
	９４ ２０年国債	5,200,000,000	5,941,988,000	
	９５ ２０年国債	5,805,000,000	6,742,333,350	
	１０１ ２０年国債	5,360,000,000	6,352,404,000	
	１０２ ２０年国債	5,200,000,000	6,190,288,000	
	１０６ ２０年国債	5,000,000,000	5,897,800,000	
	１１０ ２０年国債	5,200,000,000	6,139,172,000	
	１１１ ２０年国債	500,000,000	596,850,000	

	１４０　２０年国債	5,200,000,000	6,152,640,000	
国債証券　合計			190,028,132,780	
合計			190,028,132,780	

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

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,446,048,883	2,093,939,692
金銭信託	－	85,584,028
コール・ローン	538,775,961	500,392,421
投資証券	82,364,733,640	71,642,034,168
派生商品評価勘定	4,537	640,517
未収入金	704,717,189	238,920,726
未収配当金	80,712,149	112,074,667
流動資産合計	85,134,992,359	74,673,586,219
資産合計	85,134,992,359	74,673,586,219
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	100,463	664,077
未払金	42,759,053	82,114,953
未払解約金	90,000,000	108,587,000
その他未払費用	－	537
流動負債合計	132,859,516	191,366,567
負債合計	132,859,516	191,366,567
純資産の部		
元本等		

元本　※1	31,612,963,065	29,755,052,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	53,389,169,778	44,727,167,562
元本等合計	85,002,132,843	74,482,219,652
純資産合計	85,002,132,843	74,482,219,652
負債純資産合計	85,134,992,359	74,673,586,219

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日
期首元本額	35,135,908,736円	31,612,963,065円
期中追加設定元本額	71,792,320円	444,560,259円
期中一部解約元本額	3,594,737,991円	2,302,471,234円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（毎月分配型）	28,103,712,483円	26,037,507,239円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	26,199,932円	27,340,397円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,060,844円	14,027,721円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,222,482円	12,573,171円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	60,847,280円	63,955,061円
６資産バランスファンド（分配型）	117,184,487円	130,121,054円
６資産バランスファンド（成長型）	271,506,031円	291,776,011円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,342,828,382円	1,282,688,801円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	36,425,245円	39,723,864円

	『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	3,311,621円	3,187,040円
	常陽３分法ファンド	154,908,174円	163,428,705円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	37,196,574円	41,199,915円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	261,456,651円	320,686,778円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	339,963,833円	398,647,607円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	438,330,166円	513,512,756円
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴファンド（ダイワＳＭＡ専用）	19,380,214円	－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）	328,622,766円	360,668,008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）	21,308,000円	24,953,108円
	ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	25,497,900円	29,054,854円
計		31,612,963,065円	29,755,052,090円
2.	期末日における受益権の総数	31,612,963,065口	29,755,052,090口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年9月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,059,764,070	4,818,898,952
合計	2,059,764,070	4,818,898,952

（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（2019年9月18日から2020年3月6日まで、及び2020年3月17日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2020年3月6日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	104,695,546	－	104,691,009	4,537	238,225,894	－	238,889,971	△664,077
アメリカ・ドル	24,103,837	－	24,099,300	4,537	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	132,350,292	－	132,864,673	△514,381
シンガポール・ドル	－	－	－	－	105,875,602	－	106,025,298	△149,696
ユーロ	80,591,709	－	80,591,709	0	－	－	－	－
買　建	104,695,546	－	104,595,083	△100,463	238,225,894	－	238,866,411	640,517
アメリカ・ドル	80,591,709	－	80,493,218	△98,491	238,225,894	－	238,866,411	640,517
イギリス・ポンド	24,103,837	－	24,101,865	△1,972	－	－	－	－
合計	209,391,092	－	209,286,092	△95,926	476,451,788	－	477,756,382	△23,560

（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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.6888円	2.5032円
（1万口当たり純資産額）	(26,888円)	(25,032円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	252,463	17,733,001.120	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	207,435	7,768,440.750	
		EQUINIX INC	41,495	31,211,709.100	
		AMERICAN TOWER CORP	7,454	1,863,350.920	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	640,933	7,652,740.020	
		CYRUSONE INC	125,479	9,771,049.730	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	60,784	1,615,638.720	
		INVITATION HOMES INC	361,781	10,372,261.270	
		AMERICOLD REALTY TRUST	173,353	6,577,012.820	
		VICI PROPERTIES INC	639,094	14,622,470.720	
		STORE CAPITAL CORP	156,696	4,373,385.360	
		VENTAS INC	357,776	15,942,498.560	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,685	1,394,724.150	
		VEREIT INC	1,887,139	13,115,616.050	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142,579	5,199,856.130	
		SUN COMMUNITIES INC	59,575	8,679,481.750	

	PROLOGIS INC	239,658	24,147,940.080	
	SITE CENTERS CORP	320,328	2,658,722.400	
	DUKE REALTY CORP	501,985	19,160,767.450	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	66,737	14,966,439.620	
	WELLTOWER INC	350,668	21,432,828.160	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	371,726	10,538,432.100	
	KILROY REALTY CORP	138,313	8,008,322.700	
	PUBLIC STORAGE	113,125	23,998,337.500	
	UDR INC	414,751	14,644,857.810	
	WP CAREY INC	121,353	8,500,777.650	
	AGREE REALTY CORP	51,679	3,432,002.390	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,056	6,250,870.080	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	113,989	12,350,708.150	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	375,568	6,910,451.200	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 334,894,694.460 (35,619,399,703)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	6,692,506	5,354,004.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,363,876	7,420,849.310	
	SEGRO PLC	1,631,735	14,972,800.360	
	UNITE GROUP PLC/THE	415,030	3,934,484.400	
	DERWENT LONDON PLC	180,722	4,897,566.200	
	WORKSPACE GROUP PLC	168,339	915,764.160	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	570,099	4,361,257.350	
	BIG YELLOW GROUP PLC	231,121	2,431,392.920	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,201,667	5,059,430.760	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 49,347,550.260 (6,954,550,259)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	NATIONAL STORAGE REIT	6,490,724	12,202,561.120	
	MIRVAC GROUP	11,577,990	24,429,558.900	
	STOCKLAND	2,903,311	10,655,151.370	
	GOODMAN GROUP	2,466,876	44,773,799.400	
	CHARTER HALL GROUP	2,280,644	28,530,856.440	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,465,159	11,339,731.400	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル	

			131,931,658.630 (10,224,703,544)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384,355	14,482,496.400	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 14,482,496.400 (1,177,861,432)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	7,045,541	20,502,524.310	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	6,759,400	9,260,378.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	8,893,100	14,673,615.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,259,077	24,097,446.450	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3,501,335	10,749,098.450	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 79,283,062.210 (6,177,736,207)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	5,760,653	13,105,485.570	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 13,105,485.570 (935,600,615)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	561,006	6,855,493.320	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	44,297	1,712,964.990	
	NSI NV	82,711	2,439,974.500	
	ARGAN	41,788	3,593,768.000	
	GECINA SA	71,229	7,913,541.900	
	KLEPIERRE	681,451	9,414,245.560	
	COVIVIO	111,561	6,766,174.650	
	AEDIFICA	106,112	10,632,422.400	
	COFINIMMO	61,923	7,480,298.400	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	223,971	6,578,028.270	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	45,734	2,332,434.000	
ユーロ　小計			ユーロ 65,719,345.990 (8,272,094,079)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	2,637,892	166,187,196.000	
香港・ドル　小計			香港・ドル	

			166,187,196.000 (2,280,088,329)	
投資証券　合計			71,642,034,168 [71,642,034,168]	
合計			71,642,034,168 [71,642,034,168]	

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	30銘柄	100%	49.8%
イギリス・ポンド	投資証券	9銘柄	100%	9.7%
オーストラリア・ドル	投資証券	6銘柄	100%	14.3%
カナダ・ドル	投資証券	1銘柄	100%	1.6%
シンガポール・ドル	投資証券	5銘柄	100%	8.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	100%	1.3%
ユーロ	投資証券	11銘柄	100%	11.5%
香港・ドル	投資証券	1銘柄	100%	3.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	378,370,858
コール・ローン	7,320,537,466	2,212,257,504

投資証券 ※2	105,284,255,250	81,557,065,080
派生商品評価勘定	1,731,300	－
未収入金	843,350,755	450,819,129
未収配当金	1,402,699,225	1,071,323,358
前払金	143,544,400	－
流動資産合計	114,996,118,396	85,669,835,929
資産合計	114,996,118,396	85,669,835,929
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	331,677,230	18,583,760
前受金	－	9,671,800
未払金	1,111,498,774	407,787,859
未払解約金	3,594,000	3,732,000
その他未払費用	－	1,884
流動負債合計	1,446,770,004	439,777,303
負債合計	1,446,770,004	439,777,303
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	36,114,831,133	30,904,062,689
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	77,434,517,259	54,325,995,937
元本等合計	113,549,348,392	85,230,058,626
純資産合計	113,549,348,392	85,230,058,626
負債純資産合計	114,996,118,396	85,669,835,929

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日
期首元本額	39,544,852,747円	36,114,831,133円
期中追加設定元本額	1,281,123,907円	34,345,045,251円
期中一部解約元本額	4,711,145,521円	39,555,813,695円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	308,920円	28,144,078,777円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,134,155円	12,369,370円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,706,965円	11,453,977円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	52,046,382円	55,257,729円
６資産バランスファンド（分配型）	99,003,027円	118,904,158円
６資産バランスファンド（成長型）	234,883,573円	259,381,939円

	世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	30,821,520円	34,135,415円
	『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	1,325,144円	1,419,810円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	31,852,215円	36,935,088円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	223,783,637円	287,666,924円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	292,181,409円	356,357,924円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	378,418,063円	458,970,296円
	ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	337,883,455円	329,388,172円
	ダイワファンドラップ J-REITセレクト	33,670,725,103円	－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）	69,594,549円	77,344,985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）	21,834,805円	25,693,710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）	117,505,973円	131,383,722円
	ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年4回決算型）	531,822,238円	563,320,693円
計		36,114,831,133円	30,904,062,689円
2.	期末日における受益権の総数	36,114,831,133口	30,904,062,689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　775,000,000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　1,008,400,000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　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年9月7日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△6,368,641,009	1,268,908,022
合計	△6,368,641,009	1,268,908,022

（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（2019年11月12日から2020年3月6日まで、及び2020年5月12日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種　類	2020年3月6日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 不動産投信指数先物取引 買　建	6,914,180,400	－	6,584,589,000	△329,591,400	2,389,794,200	－	2,371,364,000	△18,430,200
合計	6,914,180,400	－	6,584,589,000	△329,591,400	2,389,794,200	－	2,371,364,000	△18,430,200

（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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.1441円	2.7579円

（1万口当たり純資産額）	(31,441円)	(27,579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	1,428	144,513,600	
	サンケイリアルエステート	2,797	254,247,300	
	SOSILA物流リート投	7,063	940,791,600	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	9,598	752,483,200	
	森ヒルズリート	16,484	2,182,481,600	
	産業ファンド	17,909	3,193,174,700	
	アドバンス・レジデンス	14,032	4,307,824,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	17,521	3,255,401,800	
	ＧＬＰ投資法人	17,962	2,922,417,400	
	コンフォリア・レジデンシャル	2,322	733,752,000	
	日本プロロジスリート	11,176	3,861,308,000	
	ＯＮＥリート投資法人	217	53,208,400	
	イオンリート投資	9,283	1,053,620,500	
	ヒューリックリート投資法	12,833	1,758,121,000	
	日本リート投資法人	736	263,856,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	42,194	606,327,780	
	積水ハウス・リート投資	24,442	1,818,484,800	
	トーセイ・リート投資法人	1,100	117,150,000	
	ケネディクス商業リート	4,753	1,021,895,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,070	611,442,000	
	野村不動産マスターＦ	35,393	4,615,247,200	
	ラサールロジポート投資	7,765	1,340,239,000	
	スターアジア不動産投	9,678	420,993,000	
	三井不ロジパーク	5,428	2,849,700,000	
	森トラスト・ホテルリート投	6,250	656,250,000	
	三菱地所物流REIT	2,565	1,079,865,000	
	CREロジスティクスファンド	4,537	680,550,000	
	ザイマックス・リート	10,433	902,454,500	

	日本ビルファンド	8,119	5,050,018,000	※
	ジャパンリアルエステイト	11,061	6,337,953,000	※
	日本リテールファンド	18,478	2,932,458,600	
	オリックス不動産投資	17,759	2,752,645,000	
	日本プライムリアルティ	5,866	1,856,589,000	
	プレミア投資法人	8,472	1,020,876,000	
	東急リアル・エステート	9,082	1,256,040,600	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,334	2,890,609,400	
	森トラスト総合リート	2,861	389,096,000	
	インヴィンシブル投資法人	35,022	1,078,677,600	
	フロンティア不動産投資	1,438	498,267,000	
	平和不動産リート	5,621	669,461,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	3,731	1,046,172,400	
	福岡リート投資法人	602	80,848,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	2,777	1,705,078,000	
	いちごオフィスリート投資法人	1,273	94,329,300	
	大和証券オフィス投資法人	1,950	1,150,500,000	
	阪急阪神リート投資法人	954	111,713,400	
	スターツプロシード投資法人	551	109,704,100	
	大和ハウスリート投資法人	18,012	4,773,180,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	26,738	1,295,456,100	
	ジャパンエクセレント投資法人	16,813	2,059,592,500	
投資証券　合計			81,557,065,080	
合計			81,557,065,080	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　　700口　　ジャパンリアルエステイト　　1,000口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ外国ハーモニーストック・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

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	27,456,140	2,759,893
金銭信託	－	165,742
コール・ローン	2,900,066	969,063
株式	1,293,617,691	1,313,187,078
派生商品評価勘定	22,942	4,550
未収入金	20,515,952	27,158,262
未収配当金	1,903,867	1,410,557
流動資産合計	1,346,416,658	1,345,655,145
資産合計	1,346,416,658	1,345,655,145
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	26,858
未払金	43,501,380	－
未払解約金	－	21,000,000
その他未払費用	－	15
流動負債合計	43,501,380	21,026,873
負債合計	43,501,380	21,026,873
純資産の部		
元本等		
元本　※1	577,815,994	488,306,279
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	725,099,284	836,321,993
元本等合計	1,302,915,278	1,324,628,272
純資産合計	1,302,915,278	1,324,628,272
負債純資産合計	1,346,416,658	1,345,655,145

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日

期首元本額	632,451,198円	577,815,994円
期中追加設定元本額	4,989,626円	62,372,894円
期中一部解約元本額	59,624,830円	151,882,609円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
６資産バランスファンド（分配型）	133,797,567円	124,270,566円
６資産バランスファンド（成長型）	401,955,030円	328,383,422円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	42,063,397円	35,652,291円
計	577,815,994円	488,306,279円
2. 期末日における受益権の総数	577,815,994口	488,306,279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 2020年3月7日 至 2020年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	53,628,667	291,275,930
合計	53,628,667	291,275,930

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年9月7日から2020年3月6日まで、及び2020年3月7日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2020年3月6日 現在				2020年9月7日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	12,945,246	－	12,944,226	1,020	23,817,218	－	23,844,076	△26,858
アメリカ・ドル	－	－	－	－	21,000,000	－	21,022,746	△22,746
イギリス・ポンド	7,015,560	－	7,014,540	1,020	－	－	－	－
ユーロ	5,929,686	－	5,929,686	0	－	－	－	－
香港・ドル	－	－	－	－	2,817,218	－	2,821,330	△4,112
買 建	12,945,246	－	12,967,168	21,922	2,817,218	－	2,821,768	4,550
アメリカ・ドル	12,945,246	－	12,967,168	21,922	2,817,218	－	2,821,768	4,550
合計	25,890,492	－	25,911,394	22,942	26,634,436	－	26,665,844	△22,308

（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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.2549円	2.7127円
（1万口当たり純資産額）	(22,549円)	(27,127円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABORATORIES	1,180	104.160	122,908.800	
	VERISK ANALYTICS INC	125	182.770	22,846.250	
	ADOBE INC	330	491.940	162,340.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	100	298.430	29,843.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	250	166.690	41,672.500	
	DR HORTON INC	400	68.230	27,292.000	
	AUTODESK INC	140	233.880	32,743.200	
	MOODY'S CORP	150	282.470	42,370.500	
	CITIGROUP INC	360	52.520	18,907.200	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	100	138.530	13,853.000	
	DANAHER CORP	375	196.580	73,717.500	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	250	100.080	25,020.000	
	APPLE INC	8,920	120.960	1,078,963.200	
	BOEING CO/THE	50	171.050	8,552.500	
	BECTON DICKINSON AND CO	90	234.080	21,067.200	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,195	60.480	72,273.600	
	ANSYS INC	200	321.210	64,242.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	1,150	103.520	119,048.000	
	CADENCE DESIGN SYS INC	730	105.880	77,292.400	
	SERVICENOW INC	315	450.350	141,860.250	
	CATERPILLAR INC	200	148.180	29,636.000	
	CISCO SYSTEMS INC	330	40.820	13,470.600	
	MORGAN STANLEY	1,200	52.710	63,252.000	
	MSCI INC	50	348.180	17,409.000	
	BROADCOM INC	135	362.950	48,998.250	
	SPLUNK INC	290	200.140	58,040.600	
	DEERE & CO	150	211.340	31,701.000	
	NASDAQ INC	100	130.290	13,029.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	250	269.590	67,397.500	
	AMETEK INC	400	99.470	39,788.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	250	346.570	86,642.500	

ACTIVISION BLIZZARD INC	625	79.010	49,381.250	
SVB FINANCIAL GROUP	100	259.730	25,973.000	
T-MOBILE US INC	450	114.290	51,430.500	
COCA-COLA CO/THE	1,130	51.040	57,675.200	
CSX CORP	150	75.510	11,326.500	
AMAZON.COM INC	263	3,294.620	866,485.060	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	230	83.710	19,253.300	
EXXON MOBIL CORP	100	39.080	3,908.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	500	96.840	48,420.000	
NEXTERA ENERGY INC	230	277.320	63,783.600	
FASTENAL CO	1,510	46.270	69,867.700	
FISERV INC	100	99.030	9,903.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100	210.940	21,094.000	
ALPHABET INC-CL C	295	1,591.040	469,356.800	
IHS MARKIT LTD	300	79.190	23,757.000	
HOME DEPOT INC	600	269.660	161,796.000	
HUMANA INC	90	413.190	37,187.100	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	100	266.450	26,645.000	
ZOETIS INC	450	157.240	70,758.000	
JOHNSON & JOHNSON	1,000	148.590	148,590.000	
KLA CORP	350	193.370	67,679.500	
LOCKHEED MARTIN CORP	25	385.020	9,625.500	
LOWE'S COS INC	650	156.390	101,653.500	
ELI LILLY & CO	270	150.910	40,745.700	
LAM RESEARCH CORP	145	333.120	48,302.400	
MCDONALD'S CORP	375	211.730	79,398.750	
FACEBOOK INC-CLASS A	2,260	282.730	638,969.800	
S&P GLOBAL INC	100	345.180	34,518.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	120	175.540	21,064.800	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	100	201.850	20,185.000	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	75	949.260	71,194.500	
MERCK & CO. INC.	710	85.240	60,520.400	
WORKDAY INC-CLASS A	300	215.800	64,740.000	
TRANSUNION	175	84.060	14,710.500	
NIKE INC -CL B	600	112.400	67,440.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	100	209.100	20,910.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	35	339.030	11,866.050	
LINDE PLC	185	247.700	45,824.500	

PFIZER INC	1,170	36.360	42,541.200	
STRYKER CORP	50	197.620	9,881.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,090	137.960	150,376.400	
TELADOC HEALTH INC	80	198.290	15,863.200	
TWILIO INC - A	160	233.500	37,360.000	
PEPSICO INC	460	138.760	63,829.600	
ACCENTURE PLC-CL A	300	236.070	70,821.000	
QUALCOMM INC	1,150	115.970	133,365.500	
REPUBLIC SERVICES INC	150	93.500	14,025.000	
CHEVRON CORP	125	81.930	10,241.250	
TESLA INC	530	418.320	221,709.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	270	160.130	43,235.100	
SYNOPSYS INC	470	208.980	98,220.600	
AT&T INC	100	29.420	2,942.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	470	140.470	66,020.900	
SALESFORCE.COM INC	530	254.700	134,991.000	
TERADYNE INC	290	78.600	22,794.000	
UNION PACIFIC CORP	250	191.140	47,785.000	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	280	61.170	17,127.600	
UNITEDHEALTH GROUP INC	365	312.000	113,880.000	
ANTHEM INC	40	276.220	11,048.800	
WALT DISNEY CO/THE	500	131.990	65,995.000	
WASTE MANAGEMENT INC	150	111.210	16,681.500	
WALMART INC	650	142.830	92,839.500	
TJX COMPANIES INC	150	55.180	8,277.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	935	204.660	191,357.100	
PULTEGROUP INC	530	43.210	22,901.300	
NVIDIA CORP	590	504.900	297,891.000	
NETFLIX INC	190	516.050	98,049.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	315	409.980	129,143.700	
ORACLE CORP	400	55.730	22,292.000	
MASTERCARD INC - A	535	335.010	179,230.350	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	350	161.710	56,598.500	
BANK OF AMERICA CORP	2,100	26.540	55,734.000	
AMERICAN EXPRESS CO	240	105.670	25,360.800	
ANALOG DEVICES INC	120	117.440	14,092.800	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,900	82.010	155,819.000	

	EMERSON ELECTRIC CO	300	69.540	20,862.000	
	AON PLC-CLASS A	100	202.740	20,274.000	
	AMGEN INC	200	248.400	49,680.000	
	APPLIED MATERIALS INC	280	60.960	17,068.800	
	CME GROUP INC	25	169.620	4,240.500	
	GILEAD SCIENCES INC	215	66.010	14,192.150	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	170	82.300	13,991.000	
	INTEL CORP	1,165	50.080	58,343.200	
	ILLINOIS TOOL WORKS	300	193.900	58,170.000	
	ILLUMINA INC	60	342.390	20,543.400	
	INTUITIVE SURGICAL INC	100	735.280	73,528.000	
	TARGET CORP	440	147.230	64,781.200	
	DOVER CORP	200	109.620	21,924.000	
	MICROSOFT CORP	4,005	214.250	858,071.250	
	MEDTRONIC PLC	450	105.740	47,583.000	
	MICRON TECHNOLOGY INC	380	46.480	17,662.400	
	BLACKROCK INC	105	564.630	59,286.150	
	KANSAS CITY SOUTHERN	95	188.000	17,860.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	925	191.840	177,452.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	100	216.220	21,622.000	
	PACCAR INC	400	85.620	34,248.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	115	370.660	42,625.900	
	STARBUCKS CORP	400	86.270	34,508.000	
	INTUIT INC	205	333.110	68,287.550	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	480	41.480	19,910.400	
	ELECTRONIC ARTS INC	100	130.130	13,013.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	90	266.500	23,985.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	750	44.430	33,322.500	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 10,989,474.860 (1,168,840,546)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	UNILEVER PLC	250	44.260	11,065.000	
	PRUDENTIAL PLC	1,200	11.350	13,620.000	
	RIO TINTO PLC	360	45.755	16,471.800	
	ASTRAZENECA PLC	675	79.700	53,797.500	
	BHP GROUP PLC	700	16.554	11,587.800	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	200	84.880	16,976.000	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	100	10.782	1,078.200	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 124,596.300 (17,559,357)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SHOPIFY INC - CLASS A	50	1,270.000	63,500.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	100	135.380	13,538.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 77,038.000 (6,265,501)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	195	317.250	61,863.750	
	ABB LTD-REG	490	23.230	11,382.700	
	NESTLE SA-REG	890	108.320	96,404.800	
	NOVARTIS AG-REG	565	78.780	44,510.700	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	700	62.740	43,918.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 258,079.950 (30,050,829)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	350	408.900	143,115.000	
	DSV PANALPINA A/S	485	950.200	460,847.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 603,962.000 (10,219,037)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	380	115.700	43,966.000	
	ALLIANZ SE-REG	180	178.680	32,162.400	
	SAP SE	350	132.860	46,501.000	
	ADIDAS AG	135	262.700	35,464.500	
	PUMA SE	250	68.340	17,085.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG	190	148.700	28,253.000	
	WOLTERS KLUWER	350	68.200	23,870.000	
	ASML HOLDING NV	325	304.800	99,060.000	
	UNILEVER NV	250	48.820	12,205.000	
	KERING	25	555.000	13,875.000	
	L'OREAL	100	273.900	27,390.000	

	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	95	402.850	38,270.750	
	AIRBUS SE	190	69.780	13,258.200	
	ENEL SPA	2,870	7.412	21,272.440	
	STMICROELECTRONICS NV	1,540	23.620	36,374.800	
ユーロ　小計				ユーロ 489,008.090 (61,551,448)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	TENCENT HOLDINGS LTD	2,300	518.000	1,191,400.000	
	AIA GROUP LTD	2,200	78.000	171,600.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 1,363,000.000 (18,700,360)	
合計				1,313,187,078 [1,313,187,078]	

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	134銘柄	100%	89.0%
イギリス・ポンド	株式	7銘柄	100%	1.3%
カナダ・ドル	株式	2銘柄	100%	0.5%
スイス・フラン	株式	5銘柄	100%	2.3%
デンマーク・クローネ	株式	2銘柄	100%	0.8%
ユーロ	株式	15銘柄	100%	4.7%
香港・ドル	株式	2銘柄	100%	1.4%

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。

「ダイワ日本ハーモニーストック・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

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	―	5,884,310
コール・ローン	58,659,363	34,404,364
株式	1,182,383,300	1,303,229,200
未収入金	―	35,226,518
未収配当金	2,951,250	42,000
流動資産合計	1,243,993,913	1,378,786,392
資産合計	1,243,993,913	1,378,786,392
負債の部		
流動負債		
未払金	―	48,778,367
未払解約金	1,000,000	1,000,000
その他未払費用	―	33
流動負債合計	1,000,000	49,778,400
負債合計	1,000,000	49,778,400
純資産の部		
元本等		
元本　※1	1,109,717,752	1,045,044,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	133,276,161	283,963,934
元本等合計	1,242,993,913	1,329,007,992
純資産合計	1,242,993,913	1,329,007,992
負債純資産合計	1,243,993,913	1,378,786,392

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2020年3月7日 至　2020年9月7日

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1．※1　期首	2019年9月7日	2020年3月7日
期首元本額	1,209,179,367円	1,109,717,752円
期中追加設定元本額	10,930,270円	71,769,991円
期中一部解約元本額	110,391,885円	136,443,685円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
６資産バランスファンド（分配型）	255,431,945円	251,851,391円
６資産バランスファンド（成長型）	774,016,324円	715,882,051円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	80,269,483円	77,310,616円
計	1,109,717,752円	1,045,044,058円
2．　期末日における受益権の総数	1,109,717,752口	1,045,044,058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　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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	2020年9月7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	2020年3月6日現在	2020年9月7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	△49,403,801	151,682,040
合計	△49,403,801	151,682,040

（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（2019年9月7日から2020年3月6日まで、及び2020年3月7日から2020年9月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年3月6日現在	2020年9月7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）

	2020年3月6日現在	2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1201円 (11,201円)	1.2717円 (12,717円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
ニチレイ	10,500	2,704.00	28,392,000	
旭　化　成	58,000	928.20	53,835,600	
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	10,340.00	35,156,000	
信越化学	3,100	13,490.00	41,819,000	
積水化学	39,200	1,685.00	66,052,000	
野村総合研究所	12,000	2,764.00	33,168,000	
花　王	6,000	7,860.00	47,160,000	
テ　ル　モ	21,000	4,295.00	90,195,000	
第一三共	5,700	9,294.00	52,975,800	
オリエンタルランド	3,400	14,465.00	49,181,000	
ディスコ	2,000	23,610.00	47,220,000	
ＳＭＣ	700	57,710.00	40,397,000	
ダイキン工業	4,000	19,900.00	79,600,000	
ダイフク	3,700	9,220.00	34,114,000	
日本電産	9,500	8,896.00	84,512,000	
ソ　ニ　ー	5,100	8,198.00	41,809,800	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	2,400	11,350.00	27,240,000	
ヒロセ電機	800	12,270.00	9,816,000	
キーエンス	900	43,470.00	39,123,000	
村田製作所	4,000	6,507.00	26,028,000	
トヨタ自動車	7,500	6,966.00	52,245,000	
ＨＯＹＡ	3,600	10,500.00	37,800,000	

任　天　堂	1,300	58,950.00	76,635,000	
東京エレクトロン	1,900	26,400.00	50,160,000	
日本ユニシス	13,500	2,945.00	39,757,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	75,000	443.40	33,255,000	
東京海上ＨＤ	5,500	4,817.00	26,493,500	
三井不動産	18,000	1,926.50	34,677,000	
光通信	400	24,550.00	9,820,000	
ＮＴＴデータ	12,000	1,216.00	14,592,000	
合計			1,303,229,200	

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【６資産バランスファンド（成長型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期計算期間（2020年3月7日から2020年9月7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】

6資産バランスファンド（成長型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 2020年3月6日現在	第29期 2020年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	17,471,791
コール・ローン	139,271,239	102,154,010
親投資信託受益証券	3,608,803,709	3,612,553,451
未収入金	5,000,000	－
流動資産合計	3,753,074,948	3,732,179,252
資産合計	3,753,074,948	3,732,179,252
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	63,691,933	62,057,126
未払解約金	5,190,331	1,676,803
未払受託者報酬	1,098,890	959,399
未払委託者報酬	28,571,971	24,945,788
その他未払費用	165,131	143,891
流動負債合計	98,718,256	89,783,007
負債合計	98,718,256	89,783,007
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,184,596,693	※1 3,102,856,338
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	469,759,999	539,539,907
（分配準備積立金）	325,967,158	369,388,682
元本等合計	3,654,356,692	3,642,396,245
純資産合計	3,654,356,692	3,642,396,245
負債純資産合計	3,753,074,948	3,732,179,252

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　2019年9月7日 至　2020年3月6日	第29期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
営業収益		
受取利息	56	167
有価証券売買等損益	26,496,776	162,749,742
営業収益合計	26,496,832	162,749,909
営業費用		
支払利息	9,124	10,348
受託者報酬	1,098,890	959,399
委託者報酬	※1 28,571,971	※1 24,945,788
その他費用	165,164	144,043
営業費用合計	29,845,149	26,059,578
営業利益又は営業損失（△）	△ 3,348,317	136,690,331
経常利益又は経常損失（△）	△ 3,348,317	136,690,331
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 3,348,317	136,690,331
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（△）	10,995,095	△ 11,621,486
期首剰余金又は期首欠損金（△）	572,356,963	469,759,999
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,371,211	6,024,843
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,371,211	6,024,843
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,932,830	22,499,626
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,932,830	22,499,626
分配金	※2 63,691,933	※2 62,057,126
期末剰余金又は期末欠損金（△）	469,759,999	539,539,907

(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29期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7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 2020年9月6日が休日のため、当計算期間末日を2020年9月7日としております。このため、当計算期間は185日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第28期 2020年3月6日現在	第29期 2020年9月7日現在
1．※1　期首元本額	3,340,021,247円	3,184,596,693円
期中追加設定元本額	59,843,886円	71,640,948円
期中一部解約元本額	215,268,440円	153,381,303円
2．計算期間末日における受益権の総数	3,184,596,693口	3,102,856,338口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第28期 自　2019年9月7日 至　2020年3月6日	第29期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7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	1,997,600円	1,799,948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（14,392,447円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（223,372,448円）及び分配準備積立金（375,266,644円）より分配対象額は613,031,539円（1万口当たり1,924.99円）であり、うち63,691,933円（1万口当たり200円）を分配金額としております。	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（36,035,228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（84,903,636円）、投資信託約款に規定される収益調整金（224,886,320円）及び分配準備積立金（310,506,944円）より分配対象額は656,332,128円（1万口当たり2,115.25円）であり、うち62,057,126円（1万口当たり200円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第29期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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29期 2020年9月7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28期 2020年3月6日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第29期 2020年9月7日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,230,613	160,813,765
合計	7,230,613	160,813,765

（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28期 2020年3月6日現在	第29期 2020年9月7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29期 自　2020年3月7日 至　2020年9月7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28期 2020年3月6日現在	第29期 2020年9月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1475円 (11,475円)	1.1739円 (11,739円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	99,615,166	183,222,174	
	ダイワ日本国債マザーファンド	144,877,457	182,415,206	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	291,776,011	730,373,710	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	259,381,939	715,349,449	
	ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド	715,882,051	910,387,204	
	ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド	328,383,422	890,805,708	
親投資信託受益証券　合計			3,612,553,451	
合計			3,612,553,451	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」受益証券、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド」受益証券及び「ダイワ日本ハーモニーストック・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。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「６資産バランスファンド（分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

前記「６資産バランスファンド（分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「６資産バランスファンド（分配型）」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「６資産バランスファンド（分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド」の状況

前記「６資産バランスファンド（分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド」の状況

前記「６資産バランスファンド（分配型）」に記載のとおりであります。

２　【ファンドの現況】

６資産バランスファンド（分配型）

【純資産額計算書】

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	3,210,322,303円
Ⅱ	負債総額	2,852,518円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,207,469,785円
Ⅳ	発行済数量	3,525,654,614口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9098円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	21,868,598,741円
Ⅱ	負債総額	51,642,419円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,816,956,322円
Ⅳ	発行済数量	12,016,006,038口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8157円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	190,510,944,684円
Ⅱ	負債総額	1,003,029円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	190,509,941,655円
Ⅳ	発行済数量	150,968,635,258口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2619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

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	71,749,654,274円
Ⅱ	負債総額	114,628,779円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	71,635,025,495円
Ⅳ	発行済数量	29,564,729,898口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4230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

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	88,130,217,995円
Ⅱ	負債総額	1,257,011,337円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	86,873,206,658円
Ⅳ	発行済数量	31,132,885,669口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7904円

(参考) ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

純資産額計算書

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	1,330,456,514円
Ⅱ	負債総額	26,135,763円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,304,320,751円
Ⅳ	発行済数量	493,158,411口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6448円

(参考) ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

純資産額計算書

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	1,354,828,932円
Ⅱ	負債総額	2,000,162円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,352,828,770円
Ⅳ	発行済数量	1,027,344,835口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3168円

６資産バランスファンド（成長型）

純資産額計算書

2020年9月30日

Ⅰ	資産総額	3,632,205,060円
Ⅱ	負債総額	8,223,989円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,623,981,071円
Ⅳ	発行済数量	3,096,176,235口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1705円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本ハーモニーストック・マザーファンド

前記「６資産バランスファンド（分配型）」の記載と同じ。

第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

①　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②　上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2020年9月末日現在

資本金の額	151億7,427万2,500円
発行可能株式総数	799万9,980株
発行済株式総数	260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ．商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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。

・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。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

2020年9月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	49	80,212
追加型株式投資信託	704	17,226,319
株式投資信託　　合計	753	17,306,531
単位型公社債投資信託	33	107,522
追加型公社債投資信託	14	1,435,447
公社債投資信託　合計	47	1,542,969
総合計	800	18,849,500

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（2019年４月１日から2020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 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,489		2,741
有価証券		554		22,167
前払費用		214		205
未収委託者報酬		11,468		10,847
未収収益		98		63
その他		56		62
流動資産計		40,882		36,088
固定資産				
有形固定資産	※1	206	※1	217
建物		10		7
器具備品		195		209
無形固定資産		2,821		2,362
ソフトウェア		2,804		2,028
ソフトウェア仮勘定		17		333
投資その他の資産		12,799		15,844
投資有価証券		8,493		9,153
関係会社株式		1,836		3,972
出資金		183		183
長期差入保証金		1,070		1,069
繰延税金資産		1,183		1,431
その他		31		33
固定資産計		15,827		18,424

資産合計	56,709	54,512

（単位:百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	※2 3,882	※2 3,530
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
固定負債		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	△363
評価・換算差額等合計	46	△363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	△15	△78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,669	△12,669	△12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△798	△798	△798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度（自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

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
時価のあるもの
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。

時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下の通りであります。
建物　　８～18年

器具備品　　４～17年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

（未適用の会計基準等）

１．収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年３月30日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年３月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
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。

２．時価の算定に関する会計基準等
- **「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日）**
- **「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年７月４日）**
- **「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）**

(1) 概要
国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- **「金融商品に関する会計基準」における金融商品**

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
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）
前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。
この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

※２　関係会社項目

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

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
未払金	3,788百万円	3,397百万円

３　保証債務

前事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年６月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 ３月31日	2018年 ６月26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

2019年６月21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	11,868百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,550円
④ 基準日	2019年３月31日
⑤ 効力発生日	2019年６月24日

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年６月21日定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年３月31日	2019年６月24日

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

2020年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	10,564百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	4,050円
④ 基準日	2020年３月31日
⑤ 効力発生日	2020年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）参照のこと）。

前事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,489	28,489	－
（２）未収委託者報酬	11,468	11,468	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,380	8,380	－
資産計	48,338	48,338	－
（１）未払手数料	(4,610)	(4,610)	－
（２）その他未払金	(3,882)	(3,882)	－
（３）未払費用（*2）	(2,805)	(2,805)	－
負債計	(11,298)	(11,298)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2020年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	2,741	2,741	－
（２）未収委託者報酬	10,847	10,847	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
有価証券	21,900	21,900	－
その他有価証券	8,754	8,754	－
資産計	44,243	44,243	－
（１）未払手数料	(3,988)	(3,988)	－
（２）その他未払金	(3,530)	(3,530)	－
（３）未払費用（*2）	(2,889)	(2,889)	－
負債計	(10,408)	(10,408)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（３）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	666	666
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	1,836	3,972
（３）長期差入保証金	1,070	1,069

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

当事業年度（2020年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

（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（2019年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2019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	87	55	32
（２）その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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（2020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	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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　2018年４月１日　至　2019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	389	86	-
（２）その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、証券投資信託について48百万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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	△171	△183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

(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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

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174百万円、当事業年度181百万円であります。

（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 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	731	788
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	△164	△173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△159
その他有価証券評価差額金	△85	△71
繰延税金負債合計	△244	△230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

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（2019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（2020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。

（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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020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子会社

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注１）	1,719	－	－
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資（注２）	3,293	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１）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。

(注２）当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,603	－	－

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。

（イ）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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	―	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	―	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	―	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,061	長期差入保証金	1,054

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

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　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
１株当たり純資産額　15,389.06円	１株当たり純資産額　14,732.52円
１株当たり当期純利益　4,550.81円	１株当たり当期純利益　4,050.66円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
当期純利益（百万円）	11,870	10,566
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

① 2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

② 2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

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) 受託会社

① 名称　三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額　342,037百万円（2020年3月末日現在）

③ 事業の内容

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。

(2) 販売会社

① 名称　株式会社三井住友銀行

② 資本金の額　1,770,996百万円（2020年3月末日現在）

③ 事業の内容　銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

＜参考＞「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の投資顧問会社

① 名称　コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

② 資本金の額　527千米ドル（2019年12月末日現在）

③ 事業の内容　資産運用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充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３　【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３　【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2020年3月23日	臨時報告書
2020年5月29日	有価証券届出書、有価証券報告書
2020年5月29日	有価証券報告書の訂正報告書
2020年5月29日	有価証券届出書の取下げ願い
2020年7月15日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2020年５月22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	小倉　加奈子	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

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（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61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（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月9日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之	印

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６資産バランスファンド（分配型）の2020年3月7日から2020年9月7日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、６資産バランスファンド（分配型）の2020年9月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月9日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之　印

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６資産バランスファンド（成長型）の2020年3月7日から2020年9月7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、６資産バランスファンド（成長型）の2020年9月7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。

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．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。