

【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】	2021年8月6日提出
【計算期間】	グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型） 第4特定期間 グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型） 第3計算期間 （自 2020年11月17日 至 2021年5月14日）
【ファンド名】	グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型） グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）
【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、海外のリート（不動産投資信託）に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

〈グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)〉

〈グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)〉

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）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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〈グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)〉

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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (除く日本)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
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	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (S&P先進国REIT 指数(除く日本) (円ベース))
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) (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〈グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)〉

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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経 225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本			
不動産投信 その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			その他 (S&P先進国REIT 指数(除く日本) (円ベース))
	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
	その他 ()	中南米			
		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
	決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
年6回(隔月)		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
年12回(毎月)		目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの	

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

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

< 信託金の限度額 >

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

(2) 【ファンドの沿革】

2019年10月31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)、償還金など お申込金(3)	
お取扱窓口	販売会社	<p>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。</p> <p>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 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金(3)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>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。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金(3)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

<各ファンド共通>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド(以下「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。

投資態度

<各ファンド共通>

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(登録予定を含みます。)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に投資し、投資成果をS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

ニ. 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引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。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンド	海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(登録予定を含みます。)の不動産投資信託証券(ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドを通じて実質的に投資します。)
選定の方針	ベンチマーク(S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース))の動きに連動する投資成果をめざすため、組入銘柄はベンチマークの構成銘柄であること。

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(2)【投資対象】

<各ファンド共通>

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(5)、および 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

委託会社は、信託金を、主として、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. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14. 投資証券、新投資口予約権証券、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. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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。

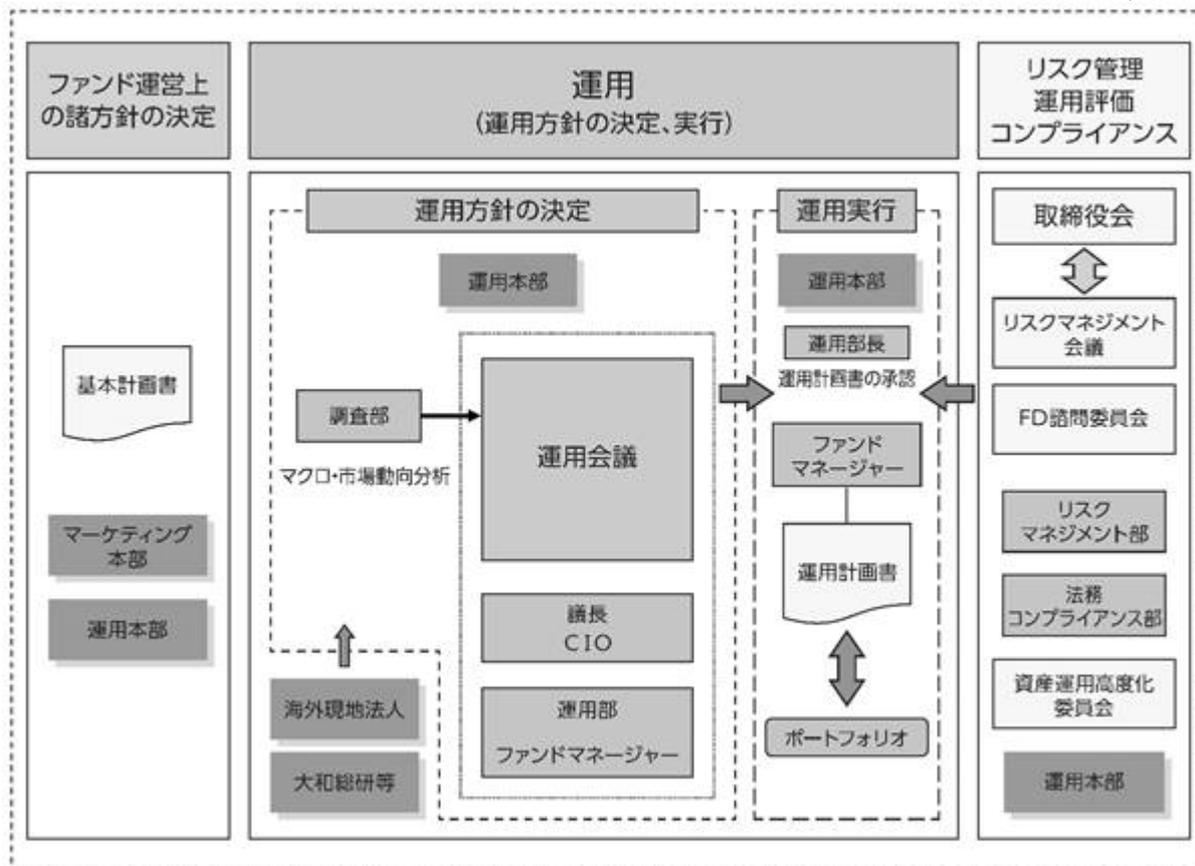
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(3)【運用体制】

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。



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。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO (Chief Investment Officer) (3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。

二．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。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は40～50名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．FD諮問委員会

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

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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。

上記の運用体制は2021年5月31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】

< 毎月決算型 >

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。

当初設定から1年以内に分配を開始し、分配開始後は、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

< 資産形成型 >

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。

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

< 各ファンド共通 >

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資する株式等の範囲（信託約款）

- イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

信用取引（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとし、
- ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等（信託約款）

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。）ならびに外国の金融商品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、わが国の金融商品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ならびに外国の金融商品取引所における通貨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。

ハ．委託会社は、わが国の金融商品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金融商品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。

スワップ取引（信託約款）

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。

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

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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。

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

デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

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。

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。

外国為替予約取引(信託約款)

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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。

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(ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド)の概要

(1) 投資方針

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「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。

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号口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。

投資態度

イ．主として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に投資し、ベンチマーク(S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)をいいます。以下同じ。)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引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。

ニ．保有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。

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

(2) 投資対象

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)に定めるものに限りません。)

ハ．約束手形

二．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

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。

委託会社は、信託金を、前 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

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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行なうことの指図をすることができます。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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

ニ．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

ホ．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。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

なお、当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため基準価額は、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。

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。

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発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付け、ご換金の申込みを取消すことがあります。

ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

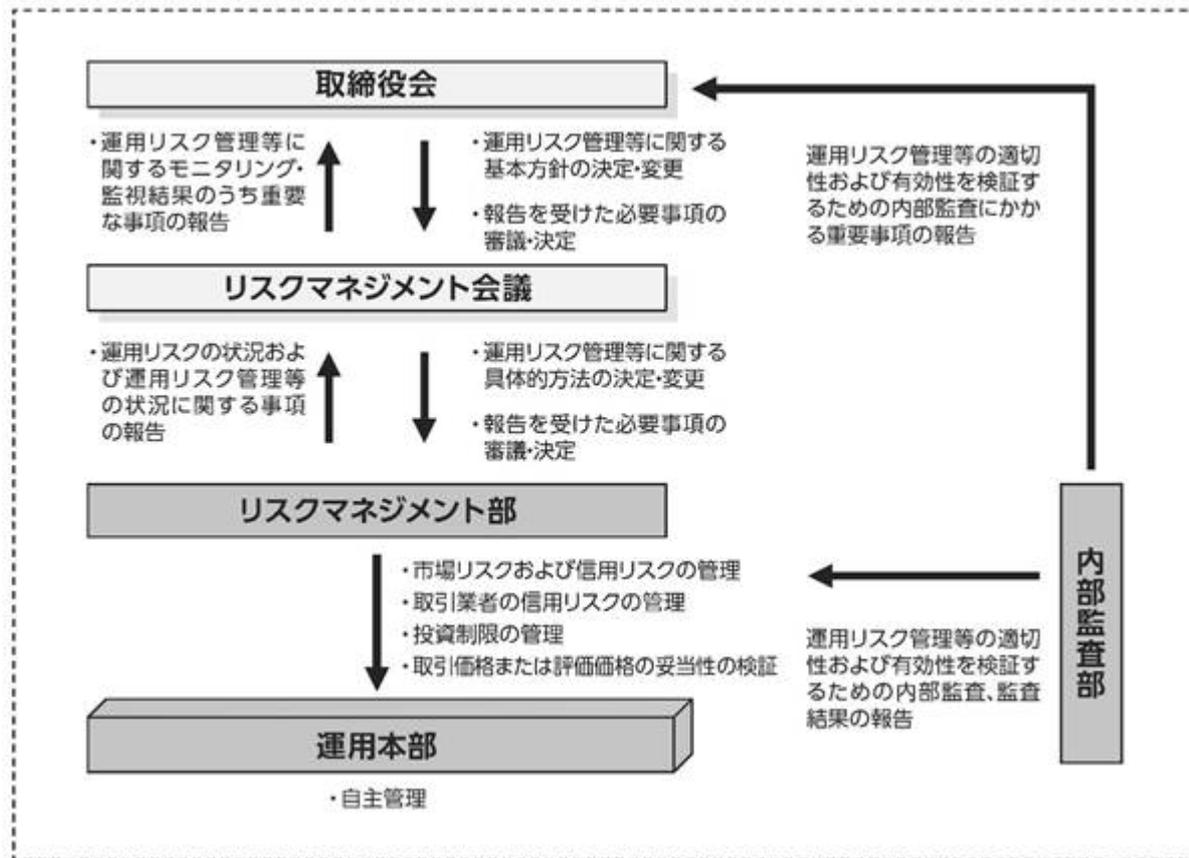
(3)その他の留意点

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

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

(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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.65%（税抜1.5%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.6875%（税抜0.625%）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。

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。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.25%（税抜）	年率0.35%（税抜）	年率0.025%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 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。

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】

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。

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。

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

信託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、先物取引・オプション取引等に要する費用、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 >

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。

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（配当控除の適用があります。）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。

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

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。

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。

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。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2021年5月31日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）】

(1) 【投資状況】（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	193,496,634	100.00
内 日本	193,496,634	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,234	0.00
純資産総額	193,504,868	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】（2021年5月31日現在）

【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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	70,079,546	2.6575 186,240,891	2.7611 193,496,634	100.00

(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	100.00%
合計	100.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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1特定期間末 (2019年11月14日)	972,788	972,788	0.9728	0.9728
第2特定期間末 (2020年5月14日)	12,754,539	12,792,370	0.6743	0.6763
2020年5月末日	16,042,494	-	0.7624	-
6月末日	18,655,390	-	0.7685	-
7月末日	25,781,191	-	0.7809	-
8月末日	39,694,216	-	0.8027	-
9月末日	38,910,905	-	0.7679	-
10月末日	41,300,656	-	0.7405	-
第3特定期間末 (2020年11月16日)	47,697,188	47,811,496	0.8345	0.8365
11月末日	50,613,614	-	0.8297	-
12月末日	59,141,099	-	0.8359	-
2021年1月末日	73,850,113	-	0.8533	-
2月末日	99,165,409	-	0.8957	-
3月末日	109,714,079	-	0.9597	-
4月末日	182,171,027	-	1.0021	-
第4特定期間末 (2021年5月14日)	183,160,362	183,532,744	0.9837	0.9857
5月末日	193,504,868	-	1.0219	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0040
第3特定期間	0.0120
第4特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.7
第2特定期間	30.3
第3特定期間	25.5
第4特定期間	19.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	0	0
第2特定期間	17,915,539	0
第3特定期間	38,263,137	24,666
第4特定期間	145,439,296	16,402,205

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	290,514,963	0.71
内 アメリカ	290,514,963	0.71
投資証券	39,818,656,735	97.66
内 ガーンジー	99,838,226	0.24
内 韓国	49,211,119	0.12
内 香港	646,863,640	1.59
内 シンガポール	1,490,013,651	3.65
内 イスラエル	17,278,409	0.04
内 イギリス	2,258,758,226	5.54
内 アイルランド	47,104,916	0.12
内 オランダ	75,443,155	0.19
内 ベルギー	511,734,149	1.26
内 フランス	944,301,084	2.32
内 ドイツ	106,568,071	0.26
内 スペイン	185,069,438	0.45
内 イタリア	7,189,113	0.02
内 カナダ	797,965,812	1.96
内 アメリカ	29,576,760,460	72.54

	内 オーストラリア	2,841,756,236	6.97
	内 ニュージーランド	162,801,030	0.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		663,251,626	1.63
純資産総額		40,772,423,324	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)	698,509,448	1.71
内 ドイツ	184,569,224	0.45
内 アメリカ	513,940,224	1.26
為替予約取引(買建)	394,376,641	0.97
内 日本	394,376,641	0.97

(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 (2021年5月31日現在)

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 PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	184,819	11,092.89 2,050,182,498	12,934.11 2,390,470,829	5.86
2 EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	22,300	76,750.66 1,711,542,330	80,862.38 1,803,231,235	4.42
3 PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	38,100	24,485.69 932,907,535	31,005.00 1,181,290,683	2.90
4 DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	70,478	15,027.68 1,059,126,907	16,635.22 1,172,417,430	2.88
5 SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	82,347	9,670.40 796,335,993	14,103.06 1,161,344,879	2.85
6 WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	104,700	7,139.88 747,548,557	8,206.75 859,247,269	2.11
7 AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	35,000	18,563.81 649,733,694	22,713.73 794,980,704	1.95
8 EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	86,000	6,600.52 567,652,004	8,500.91 731,078,432	1.79

9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	431,000	1,573.35 678,134,447	1,634.93 704,655,433	1.73
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	93,617	6,785.58 635,250,464	7,507.58 702,837,491	1.72
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,900	18,012.38 574,596,959	19,565.81 624,149,581	1.53
12	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	93,979	5,313.26 499,341,935	6,086.19 571,974,238	1.40
13	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	142,297	3,194.45 454,564,248	3,980.99 566,483,674	1.39
14	LINK REIT	香港	投資証券	533,700	974.65 520,179,134	1,058.37 564,856,872	1.39
15	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	33,100	12,334.93 408,289,770	16,443.14 544,268,119	1.33
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	16,267	27,574.45 448,554,729	32,411.03 527,230,232	1.29
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,000	15,529.06 434,815,722	18,376.01 514,528,538	1.26
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	28,728	13,816.47 396,920,654	17,638.43 506,716,874	1.24
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	135,100	3,294.77 445,124,743	3,663.78 494,977,867	1.21
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	299,800	1,419.69 425,630,026	1,623.68 486,781,063	1.19
21	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	93,700	4,260.11 399,176,661	5,099.44 477,818,428	1.17
22	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	134,600	2,853.43 384,085,034	3,416.82 459,905,156	1.13
23	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	35,600	11,215.05 399,258,871	12,903.38 459,360,527	1.13
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	74,400	4,342.32 323,069,955	5,227.86 388,953,439	0.95
25	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	44,000	7,683.85 338,093,037	8,281.39 364,381,248	0.89
26	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	72,300	3,038.70 219,703,760	4,778.95 345,518,114	0.85
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	145,500	2,184.33 317,825,962	2,323.61 338,086,594	0.83
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	24,500	10,869.64 266,308,800	13,761.70 337,161,866	0.83

29	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証 券	176,900	1,619.06 286,425,657	1,884.57 333,382,060	0.82
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証 券	42,500	6,523.14 277,234,837	7,777.59 330,547,728	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
投資信託受益証券	0.71%
投資証券	97.66%
合計	98.37%

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

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	アメリカ	DJ US REAL ESTATE 202106	買建	120	472,056,906	513,940,224	1.26%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202106	買建	153	169,422,441	184,569,224	0.45%
為替予約取引	日本	香港ドル買/円売 2021年 6月	買建	400,000	5,627,960	5,656,000	0.01%
		米ドル買/円売 2021年6 月	買建	2,490,000	271,949,055	273,297,577	0.67%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2021年6月	買建	70,000	5,507,734	5,557,909	0.01%
		ユーロ買/円売 2021年6 月	買建	560,000	73,918,412	74,898,152	0.18%
		英ポンド買/円売 2021年 6月	買建	20,000	3,122,102	3,111,946	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2021年6月	買建	90,000	8,129,997	8,172,657	0.02%

	豪ドル買/円売 2021年6月	買建	280,000	23,694,546	23,682,400	0.06%
--	-----------------	----	---------	------------	------------	-------

(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。

(参考情報) 運用実績

●グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,219円
純資産総額	1.9億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	14.8%
6カ月間	24.8%
1年間	37.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	5.7%



※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: 240円 設定来分配金合計額: 280円

決算期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期
	20年6月	20年7月	20年8月	20年9月	20年10月	20年11月	20年12月	21年1月	21年2月	21年3月	21年4月	21年5月
分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	326	99.3%	米ドル	74.4%	商業施設	17.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	5.9%
外国投資信託等	4	0.8%	豪ドル	7.0%	産業施設	15.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		1.6%	英ポンド	5.8%	住宅	15.0%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.9%
合計	330	-	ユーロ	5.1%	特殊用途施設	11.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成	比率	シンガポール・ドル	比率	各種不動産	比率	SIMON PROPERTY GROUP INC <th>商業施設</th> <th>アメリカ</th> <th>比率</th>	商業施設	アメリカ	比率	
アメリカ	74.5%	カナダ・ドル	2.0%	オフィス	9.7%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%	
オーストラリア	7.0%	香港ドル	1.7%	ヘルスケア	9.0%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.9%	
イギリス	5.5%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.9%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%	
シンガポール	3.7%	韓国ウォン	0.1%	ホテル/リゾート	2.9%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.7%	
その他	9.4%	その他	-0.0%	その他	0.0%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%	
合計	100.1%	合計	100.0%	合計	97.5%	合計			28.2%	

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※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

当ファンドのベンチマークはS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。



*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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

*2019年※は設定日(10月31日)から年末、2021年は5月31日までの騰落率を表しています。

*当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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。

【グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)】

(1) 【投資状況】(2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	474,569,535	100.00
内 日本	474,569,535	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,050	0.00
純資産総額	474,589,585	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】(2021年5月31日現在)

【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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	171,876,982	2.6585 456,949,764	2.7611 474,569,535	100.00

(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	100.00%
合計	100.00%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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1計算期間末 (2020年5月14日)	5,749,554	5,749,554	0.6782	0.6782
2020年5月末日	9,711,614	-	0.7668	-
6月末日	17,631,960	-	0.7749	-
7月末日	31,913,671	-	0.7895	-
8月末日	50,694,715	-	0.8135	-
9月末日	89,728,130	-	0.7802	-
10月末日	99,772,598	-	0.7543	-
第2計算期間末 (2020年11月16日)	125,007,636	125,007,636	0.8522	0.8522
11月末日	128,104,655	-	0.8472	-
12月末日	148,559,276	-	0.8556	-
2021年1月末日	177,860,354	-	0.8755	-
2月末日	222,126,800	-	0.9211	-
3月末日	288,045,728	-	0.9890	-
4月末日	440,966,887	-	1.0349	-
第3計算期間末 (2021年5月14日)	455,548,050	455,548,050	1.0180	1.0180
5月末日	474,589,585	-	1.0575	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	32.2
第2計算期間	25.7
第3計算期間	19.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	7,478,101	0

第2計算期間	140,458,220	2,241,804
第3計算期間	342,186,288	41,376,227

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,575円
純資産総額	4.7億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	14.8%
6カ月間	24.8%
1年間	37.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	5.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 20年5月	第2期 20年11月	第3期 21年5月						
分配金	0円	0円	0円						

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	326	99.3%	米ドル	74.4%	商業施設	17.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	5.9%
外国投資信託等	4	0.8%	豪ドル	7.0%	産業施設	15.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		1.6%	英ポンド	5.8%	住宅	15.0%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.9%
合計	330	-	ユーロ	5.1%	特殊用途施設	11.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.4%	各種不動産	10.1%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.8%
アメリカ		74.5%	カナダ・ドル	2.0%	オフィス	9.7%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%
オーストラリア		7.0%	香港ドル	1.7%	ヘルスケア	9.0%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.9%
イギリス		5.5%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫/リゾート	6.9%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%
シンガポール		3.7%	韓国ウォン	0.1%	ホテル/リゾート	2.9%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.7%
その他		9.4%	その他	-0.0%	その他	0.0%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	97.5%	合計			28.2%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の残玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。



※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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

※2019年※は設定日(10月31日)から年末、2021年は5月31日までの騰落率を表しています。

※当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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、なお、販売会社によっては「毎月決算型」または「資産形成型」のどちらか一方のみのお取扱いと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。

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌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。

継続申込期間においては、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。

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発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

<一部解約>

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消することができるものとします。

一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の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(受入担保金代用有価証券を除きます。)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

・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時において知り得る直近の日の最終相場で評価します。

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2019年10月31日から2029年11月14日までとします。ただし、(5)により信託契約を約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

<毎月決算型>

毎月15日から翌月14日までとします。ただし、第1計算期間は、2019年10月31日から2019年11月14日までとします。

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

<資産形成型>

毎年5月15日から11月14日まで、および11月15日から翌年5月14日までとします。ただし、第1計算期間は、2019年10月31日から2020年5月14日までとします。

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

(5)【その他】

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、S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）が改廃された場合、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、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 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。
7. 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、の書面決議で否決された場合を除き、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。
8. 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。

信託約款の変更等

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または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 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7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を「毎月決算型」については毎年5月および11月の計算期末に、「資産形成型」については計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知ってい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。

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。

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

【グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)】

(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11月17日から2021年5月14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】

グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 2020年11月16日現在	当 期 2021年5月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,982	116,848
親投資信託受益証券	47,809,333	183,517,658
未収入金	22,600	-
流動資産合計	47,859,915	183,634,506
資産合計		
47,859,915		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	114,308	372,382
未払解約金	20,650	-
未払受託者報酬	1,072	3,960
未払委託者報酬	25,931	95,303
その他未払費用	766	2,499
流動負債合計	162,727	474,144
負債合計		
162,727		
純資産の部		
元本等		
元本	1 57,154,010	1 186,191,101
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 9,456,822	2 3,030,739
(分配準備積立金)	4,857,870	19,702,504
元本等合計	47,697,188	183,160,362
純資産合計		
47,697,188		
負債純資産合計		
47,859,915		
183,634,506		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前 期 自 2020年5月15日 至 2020年11月16日	当 期 自 2020年11月17日 至 2021年5月14日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,606,044	18,377,525
営業収益合計	5,606,044	18,377,525
営業費用		
支払利息	-	2
受託者報酬	4,231	12,897
委託者報酬	102,922	310,853
その他費用	766	2,499
営業費用合計	107,919	326,251
営業利益	5,498,125	18,051,274
経常利益	5,498,125	18,051,274
当期純利益	5,498,125	18,051,274
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,034	226,353
期首剰余金又は期首欠損金()	6,161,000	9,456,822
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,050	1,451,303
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,050	1,451,303
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,279,756	11,423,021
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,279,756	11,423,021
分配金	1 518,207	1 1,427,120
期末剰余金又は期末欠損金()	9,456,822	3,030,739

(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11月17日	至 2021年5月14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11月14日及びその翌日が休日のため、前特定期間末日を2020年11月16日としております。このため、当特定期間は179日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在
1. 1 期首元本額	18,915,539円	57,154,010円
期中追加設定元本額	38,263,137円	145,439,296円
期中一部解約元本額	24,666円	16,402,205円
2. 特定期間末日における受益権の総数	57,154,010口	186,191,101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9,456,822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3,030,739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	当 期
	自 2020年5月15日 至 2020年11月16日	自 2020年11月17日 至 2021年5月14日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>(自2020年5月15日 至2020年6月15日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(38,907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(940,752円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,224,291円)及び分配準備積立金(1,255,361円)より分配対象額は3,459,311円(1万口当たり1,524.59円)であり、うち45,380円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年6月16日 至2020年7月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(74,095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(1,874,334円)及び分配準備積立金(2,189,640円)より分配対象額は4,138,069円(1万口当たり1,534.44円)であり、うち53,935円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年11月17日 至2020年12月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(41,526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(8,593,186円)及び分配準備積立金(4,743,338円)より分配対象額は13,378,050円(1万口当たり2,003.85円)であり、うち133,523円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年12月15日 至2021年1月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(251,819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(10,345,738円)及び分配準備積立金(4,486,272円)より分配対象額は15,083,829円(1万口当たり2,020.04円)であり、うち149,342円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
-------------------	---	--

(自2020年7月15日 至2020年8月14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(58,320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(521,125円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,184,676円)及び分配準備積立金(2,209,800円)より分配対象額は7,973,921円(1万口当たり1,636.62円)であり、うち97,443円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2020年8月15日 至2020年9月14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(41,122円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,342,079円)及び分配準備積立金(2,691,802円)より分配対象額は8,075,003円(1万口当たり1,625.01円)であり、うち99,384円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2021年1月15日 至2021年2月15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(119,849円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(4,273,538円)、投資信託約款に規定される収益調整金(15,762,928円)及び分配準備積立金(4,588,749円)より分配対象額は24,745,064円(1万口当たり2,433.89円)であり、うち203,337円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2021年2月16日 至2021年3月15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(238,016円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(6,509,672円)、投資信託約款に規定される収益調整金(18,786,023円)及び分配準備積立金(8,542,064円)より分配対象額は34,075,775円(1万口当たり3,011.52円)であり、うち226,302円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

<p>(自2020年9月15日 至2020年10月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(179,827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(6,019,786円)及び分配準備積立金(2,633,540円)より分配対象額は8,833,153円(1万口当たり1,639.46円)であり、うち107,757円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年3月16日 至2021年4月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(453,410円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,655,923円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,687,710円)及び分配準備積立金(14,555,756円)より分配対象額は54,352,799円(1万口当たり3,176.35円)であり、うち342,234円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2020年10月15日 至2020年11月16日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(121,027円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,146,708円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,554,640円)及び分配準備積立金(2,704,443円)より分配対象額は11,526,818円(1万口当たり2,016.80円)であり、うち114,308円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月15日 至2021年5月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(311,651円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,984,379円)、投資信託約款に規定される収益調整金(42,005,705円)及び分配準備積立金(16,778,856円)より分配対象額は62,080,591円(1万口当たり3,334.24円)であり、うち372,382円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期
	自 2020年11月17日 至 2021年5月14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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	2021年5月14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	当 期
	2020年11月16日現在	2021年5月14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	2,385,759	3,400,309
合計	2,385,759	3,400,309

(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11月16日現在	当 期 2021年5月14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11月17日 至 2021年5月14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11月16日現在	当 期 2021年5月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8345円 (8,345円)	0.9837円 (9,837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・グローバルREITインデックス・マザーファンド	69,069,499	183,517,658	
親投資信託受益証券 合計			183,517,658	
合計			183,517,658	

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・グローバルREITインデックス・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・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	38,409,154	55,928,842
コール・ローン	446,436,826	290,843,757
投資信託受益証券	147,484,131	189,322,240
投資証券	28,159,186,249	37,774,205,180
派生商品評価勘定	42,535,391	30,212,083
未収入金	54,037,238	18,872,873
未収配当金	72,110,092	60,077,747
差入委託証拠金	244,876,627	263,037,608
流動資産合計	29,205,075,708	38,682,500,330
資産合計	29,205,075,708	38,682,500,330
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	67,160	921,654
未払金	209,154	30,222,887
未払解約金	76,666,830	8,910,400
その他未払費用	-	279
流動負債合計	76,943,144	40,055,220

負債合計		76,943,144	40,055,220
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,140,470,122	14,543,790,336
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		15,987,662,442	24,098,654,774
元本等合計		29,128,132,564	38,642,445,110
純資産合計		29,128,132,564	38,642,445,110
負債純資産合計		29,205,075,708	38,682,500,330

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月17日 至 2021年5月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在
1. 1 期首	2020年5月15日	2020年11月17日
期首元本額	11,769,785,948円	13,140,470,122円
期中追加設定元本額	1,951,582,579円	2,838,224,024円
期中一部解約元本額	580,898,405円	1,434,903,810円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	6,143,857,056円	6,037,980,738円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	1,097,836,503円	1,097,378,560円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	377,561,079円	329,840,208円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	276,661,752円	276,304,070円
D-I's グローバルREIT インデックス	2,101,996円	1,894,087円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,685,432円	3,967,672円
iFree 外国REITイ ンデックス	123,917,628円	382,201,482円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,384,639,346円	1,415,153,168円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	56,391,069円	171,432,418円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	21,567,796円	69,069,499円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,665,828,610円	2,830,087,704円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,238,066円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,113,449円	5,774,247円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,763,877円	4,278,622円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	249,211,041円	228,872,981円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	- 円	218,996,022円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	255,459,682円	250,592,839円

ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	52,329,499円	53,401,587円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	213,292,504円	731,290,345円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	205,013,737円	435,274,087円
計	13,140,470,122円	14,543,790,336円
2. 期末日における受益権の総数	13,140,470,122口	14,543,790,336口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月17日 至 2021年5月14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。 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。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月14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11月16日現在	2021年5月14日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	10,053,276	2,620,760
投資証券	3,254,747,450	3,791,103,424
合計	3,244,694,174	3,788,482,664

（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12月3日から2020年11月16日まで、及び2020年12月1日から2021年5月14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

1. 不動産投信関連

種 類	2020年11月16日 現在				2021年5月14日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								

買 建	762,290,493	-	802,166,944	39,876,451	639,122,986	-	666,753,810	27,630,824
合計	762,290,493	-	802,166,944	39,876,451	639,122,986	-	666,753,810	27,630,824

(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。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
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。

2. 通貨関連

種 類	2020年11月16日 現在				2021年5月14日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	18,362,464	-	18,351,700	10,764	-	-	-	-
カナダ・ドル	18,362,464	-	18,351,700	10,764	-	-	-	-
買 建	364,670,984	-	367,252,000	2,581,016	265,134,209	-	266,793,814	1,659,605
アメリカ・ドル	224,678,060	-	225,019,000	340,940	197,067,411	-	198,393,557	1,326,146
オーストラリア ・ドル	-	-	-	-	5,955,803	-	5,925,255	30,548
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,491,390	-	4,503,485	12,095
ニュージーラ ンド・ドル	2,071,404	-	2,158,200	86,796	2,365,146	-	2,359,191	5,955
ユーロ	137,921,520	-	140,074,800	2,153,280	55,254,459	-	55,612,326	357,867
合計	383,033,448	-	385,603,700	2,591,780	265,134,209	-	266,793,814	1,659,605

(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。

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。

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11月16日現在	2021年5月14日現在
1口当たり純資産額	2,2167円	2,6570円
(1万口当たり純資産額)	(22,167円)	(26,570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
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	18,000,000	1,726,920,000	
		小計		1,726,920,000	
投資信託受益証券 合計				189,322,240	
				[189,322,240]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	31,300	694,234,000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,900	123,417,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	26,882	501,886,940	

XENIA HOTELS & RESORTS INC	27,100	509,751.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	34,500	6,779,250.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	81,147	9,574,534.530	
BOSTON PROPERTIES INC	35,000	3,710,350.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	36,789	246,118.410	
VORNADO REALTY TRUST	38,264	1,712,696.640	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19,500	392,730.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	15,700	683,107.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL	5,500	275,055.000	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	15,900	985,005.000	
EQUITY RESIDENTIAL	84,700	6,252,554.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	50,700	763,542.000	
EPR PROPERTIES	18,500	871,350.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	32,620.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	101,091.000	
GLOBAL NET LEASE INC	21,433	399,082.460	
EQUINIX INC	22,000	15,739,460.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,629	496,090.270	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	135,864.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8,800	135,168.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,400	985,168.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	28,300	491,854.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,500	256,740.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	174,300	2,910,810.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	66,408	2,443,814.400	
CORESITE REALTY CORP	10,400	1,212,432.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	37,300	1,000,759.000	
RLJ LODGING TRUST	39,371	582,690.800	
FARMLAND PARTNERS INC	6,700	90,383.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	51,400	932,396.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,000	181,580.000	
CYRUSONE INC	29,800	2,046,366.000	
KIMCO REALTY CORP	106,900	2,229,934.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,800	133,672.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	53,350	1,472,460.000	
WHITESTONE REIT	8,500	75,395.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	54,037	2,423,559.450	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	30,200	542,392.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	57,780	1,223,202.600	

COLONY CAPITAL INC	120,211	751,318.750	
INVITATION HOMES INC	140,197	4,859,228.020	
JBG SMITH PROPERTIES	26,432	824,149.760	
ALEXANDER & BALDWIN INC	16,500	295,020.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	11,396.000	
GLADSTONE LAND CORP	4,500	103,050.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	62,400	2,330,640.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,900	391,140.000	
VICI PROPERTIES INC	132,600	3,988,608.000	
RETAIL VALUE INC	2,990	53,341.600	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,000	160,740.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	23,751.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,800	967,904.000	
SAFEHOLD INC	3,200	221,152.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	3,329	6,225.230	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	26,000	240,500.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28,100	680,582.000	
COREPOINT LODGING INC	6,700	70,283.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,700	108,072.000	
STORE CAPITAL CORP	59,300	1,954,528.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,400	25,704.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	9,000	183,780.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,300	243,639.000	
LIFE STORAGE INC	18,650	1,791,892.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,300	424,842.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24,882	401,595.480	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12,200	112,484.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,200	411,246.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,000	385,900.000	
NETSTREIT CORP	6,300	132,363.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	36,389	1,596,749.320	
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	61,896.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	32,500	1,735,825.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	28,100	501,304.000	
STAG INDUSTRIAL INC	38,700	1,366,497.000	
VENTAS INC	92,579	4,965,011.770	
CARETRUST REIT INC	22,903	518,065.860	
GEO GROUP INC/THE	27,400	168,784.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	72,400	1,587,008.000	

OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11,800	318,718.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	51,487	881,972.310	
UMH PROPERTIES INC	8,600	181,460.000	
IRON MOUNTAIN INC	71,300	2,986,044.000	
TERRENO REALTY CORP	16,800	1,046,808.000	
VEREIT INC	56,581	2,522,380.980	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	27,920	1,258,912.800	
SUN COMMUNITIES INC	27,600	4,451,880.000	
ACADIA REALTY TRUST	21,111	442,064.340	
ALEXANDER'S INC	500	132,500.000	
PROLOGIS INC	182,019	20,659,156.500	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	31,400	5,425,292.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	40,800	547,536.000	
SAUL CENTERS INC	3,200	135,680.000	
MACK-CALI REALTY CORP	20,200	337,542.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	24,100	2,940,200.000	
COUSINS PROPERTIES INC	36,306	1,274,703.660	
SITE CENTERS CORP	40,678	583,322.520	
DUKE REALTY CORP	92,400	4,117,344.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	9,700	1,484,779.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,067	4,625,689.300	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	31,500	1,559,250.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,300	1,928,431.000	
GETTY REALTY CORP	8,803	268,227.410	
WELLTOWER INC	103,100	7,431,448.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	133,100	4,335,067.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	25,400	1,106,678.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	39,500	432,920.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	34,100	1,036,640.000	
EQUITY COMMONWEALTH	30,075	812,025.000	
KILROY REALTY CORP	26,200	1,735,488.000	
LTC PROPERTIES INC	9,600	381,120.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	73,300	884,731.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,228	4,404,414.840	
MACERICH CO/THE	28,379	381,413.760	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,900	2,885,234.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,200	754,096.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	43,300	1,942,871.000	
REALTY INCOME CORP	92,317	5,973,833.070	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	26,800	726,816.000	
PUBLIC STORAGE	37,500	10,273,125.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,900	756,952.000	
REGENCY CENTERS CORP	39,020	2,459,820.800	
RPT REALTY	17,800	219,474.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,400	341,544.000	
SL GREEN REALTY CORP	17,157	1,215,401.880	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57,500	205,562.500	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	110,220.000	
UDR INC	73,400	3,366,858.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,100	204,321.000	
WP CAREY INC	43,300	3,158,735.000	
WASHINGTON REIT	19,800	449,856.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	28,800	925,344.000	
AGREE REALTY CORP	15,500	1,063,300.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	57,248	2,027,724.160	
CUBESMART	49,400	2,067,390.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	52,626	646,773.540	
DIGITAL REALTY TRUST INC	69,378	10,333,159.320	
EXTRA SPACE STORAGE INC	32,600	4,726,674.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	82,293.750	
CENTERSPACE	2,960	206,223.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	20,550	412,027.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	23,300	442,234.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,633	89,480.790	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	33,600	1,558,032.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,800	182,248.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	51,342	492,883.200	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	143,300	2,964,877.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	105,630.000	
DOUGLAS EMMETT INC	40,300	1,298,869.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	50,900	588,404.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364,562	267,953.070	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151,400	111,279.000	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	9,247.500	
PRIME US REIT	99,000	84,645.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 255,790,032.990 (28,042,261,317)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	668,520	484,342.740	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159,570	138,187.620	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	67,100.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	131,683.110	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	102,701.280	
	REGIONAL REIT LTD	111,310	92,387.300	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	64,823.550	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	212,290	364,501.930	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155,490	180,990.360	
	CUSTODIAN REIT PLC	89,420	87,273.920	
	GCP STUDENT LIVING PLC	112,860	179,898.840	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67,900	75,640.600	
	LXI REIT PLC	118,038	158,643.070	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98,200	103,110.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	25,020.970	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180,000	146,880.000	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207,000	235,980.000	
	HOME REIT PLC	60,000	69,000.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	186,931	1,330,200.990	
	SEGREO PLC	294,290	2,924,065.440	
	HAMMERSON PLC	1,011,984	352,575.220	
	UNITE GROUP PLC/THE	97,370	1,077,399.050	
	BRITISH LAND CO PLC	229,250	1,182,471.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	60,981	430,830.760	
	DERWENT LONDON PLC	27,820	934,752.000	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	329,370	493,725.630		
WORKSPACE GROUP PLC	32,260	276,306.900		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	52,350	470,364.750		
SHAFTESBURY PLC	73,550	461,158.500		
BIG YELLOW GROUP PLC	41,560	521,578.000		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	225,150	502,084.500		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	55,875.200		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	427,740	816,983.400		
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 14,538,537.130 (2,238,643,947)	
イスラエル・ シュケル			イスラエル・シュケル	

	REIT 1 LTD	28,840	502,969.600	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 502,969.600 (16,763,927)	
オーストラリア・ドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78,380	253,951.200	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	485,284	414,917.820	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	120,890	418,279.400	
	AVENTUS GROUP	88,000	249,040.000	
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	187,842.050	
	WAYPOINT REIT	193,830	490,389.900	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	124,458	589,930.920	
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	186,890.000	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	128,880	344,109.600	
	IRONGATE GROUP	119,630	178,248.700	
	HOME CONSORTIUM	48,000	222,720.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	74,340	92,925.000	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	276,860	664,464.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,547	257,496.550	
	NATIONAL STORAGE REIT	226,195	452,390.000	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	91,958.400	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	132,558.250	
	SCENTRE GROUP	1,298,090	3,413,976.700	
	ARENA REIT	79,890	262,039.200	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	119,879.000	
	BWP TRUST	123,870	514,060.500	
	DEXUS	272,460	2,727,324.600	
	GPT GROUP	491,910	2,248,028.700	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	130,400	473,352.000	
	MIRVAC GROUP	993,860	2,683,422.000	
	STOCKLAND	602,730	2,754,476.100	
ABACUS PROPERTY GROUP	91,930	268,435.600		
GOODMAN GROUP	422,610	7,839,415.500		
VICINITY CENTRES	981,460	1,467,282.700		
CHARTER HALL GROUP	118,020	1,595,630.400		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	76,660	416,263.800		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 32,011,698.590 (2,710,110,403)	

カナダ・ドル			カナダ・ドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,100	183,825.000
	SLATE GROCERY REIT	4,100	49,815.000
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,700	241,935.000
	SLATE OFFICE REIT	5,100	22,746.000
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	89,922.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,400	307,710.000
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	20,600	328,364.000
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	80,304.000
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,800	223,452.000
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	49,036.000
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	7,600	601,236.000
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	21,600	303,264.000
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,200	252,072.000
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	26,900	465,370.000
	CHOICE PROPERTIES REIT	40,300	574,678.000
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	67,536.000
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	194,684.000
	PLAZA RETAIL REIT	11,100	43,734.000
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	18,000	523,440.000
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	21,200	1,209,460.000
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	218,335.800
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	34,966	534,280.480
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	38,900	805,619.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	115,614.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,900	215,586.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,300	205,656.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	15,600	659,724.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 8,567,398.280 (771,836,910)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	311,683	797,908.480
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	249,876	67,466.520
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	542,000	569,100.000
	AIMS APAC REIT	119,000	164,220.000
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	201,800	105,945.000
FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	683,190	1,011,121.200	

	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134,000	123,280.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	159,808.500	
	EC WORLD REIT	57,000	42,465.000	
	IREIT GLOBAL	105,124	67,804.980	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	800,677	2,337,976.840	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,144,622	2,369,367.540	
	SUNTEC REIT	535,400	797,746.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	730,200	1,409,286.000	
	KEPPEL REIT	501,400	606,694.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	453,456	462,525.120	
	ESR-REIT	559,902	223,960.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	191,600	235,668.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	327,776	773,551.360	
	STARHILL GLOBAL REIT	308,800	165,208.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	234,442	311,807.860	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	96,300	408,312.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,214,720	78,956.800	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	413,780	1,113,068.200	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	294,500	226,765.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	558,184	1,133,113.520	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248,100	148,860.000	
	SPH REIT	220,600	189,716.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	89,954.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	213,719.880	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 16,405,376.600 (1,348,193,850)	
ニュージーランド ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	194,470	282,953.850	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	392,920	483,291.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	89,920	269,310.400	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	273,220	617,477.200	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	266,820	432,248.400	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 2,085,281.450 (164,028,239)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	40,920	583,519.200	ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	17,280	155,520.000	

	WERELDHAVE NV	8,970	123,606.600	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,570	2,196,195.100	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	8,230	180,730.800	
	NSI NV	4,131	138,801.600	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	87,750.000	
	ICADE	7,490	532,164.500	
	CARMILA	10,000	146,400.000	
	ALTAREA	890	149,698.000	
	GECINA SA	12,801	1,632,767.550	
	KLEPIERRE	46,520	1,064,377.600	
	COVIVIO	11,452	859,358.080	
	MERCIALYS	8,630	90,701.300	
	AEDIFICA	7,726	781,098.600	
	COFINIMMO	6,790	884,058.000	
	BEFIMMO	5,870	204,569.500	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,610	100,959.000	
	RETAIL ESTATES	2,540	163,576.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,700	929,444.000	
	CARE PROPERTY INVEST	6,100	154,330.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,080	190,128.000	
	MONTEA	2,500	232,500.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,240	53,953.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,530	78,171.400	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	60,633	533,267.230	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	77,300	698,792.000	
	CROMWELL REIT EUR	70,920	169,498.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102,050	155,116.000	
	HIBERNIA REIT PLC	159,240	181,533.600	
	ユーロ 小計		ユーロ 13,452,585.460 (1,780,987,789)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 49,260,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	25,375	140,831,250.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,960	85,399,800.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	27,972,000.000	
	JR REIT XXVII	25,500	131,325,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,500	51,765,000.000	
	韓国・ウォン 小計		韓国・ウォン 486,553,050.000	

			(47,292,957)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349,000	1,375,060.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250,000	1,070,000.000	
	FORTUNE REIT	346,000	2,761,080.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	810,000.000	
	LINK REIT	524,000	38,199,600.000	
	CHAMPION REIT	481,000	2,140,450.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 46,356,190.000 (654,085,841)	
投資証券 合計			37,774,205,180 [37,774,205,180]	
合計			37,963,527,420 [37,963,527,420]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 156銘柄	0.7%	99.3%	74.5%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.9%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	7.1%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 30銘柄	-%	100%	4.7%
韓国・ウォン	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.1%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.7%

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。

【グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）】

(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3期計算期間（2020年11月17日から2021年5月14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】

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2020年11月16日現在	第3期 2021年5月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	182,423	1,836,877
親投資信託受益証券	125,002,082	455,495,934
未収入金	2,630	-
流動資産合計	125,187,135	457,332,811
資産合計	125,187,135	457,332,811
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,009,500
未払受託者報酬	7,079	30,728
未払委託者報酬	171,077	738,462
その他未払費用	1,343	6,071
流動負債合計	179,499	1,784,761
負債合計	179,499	1,784,761
純資産の部		
元本等		
元本	1 146,694,517	1 447,504,578
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 21,686,881	2 8,043,472
(分配準備積立金)	8,806,718	47,007,729
元本等合計	125,007,636	455,548,050
純資産合計	125,007,636	455,548,050
負債純資産合計	125,187,135	457,332,811

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2020年5月15日 至 2020年11月16日	第3期 自 2020年11月17日 至 2021年5月14日
営業収益		
有価証券売買等損益	9,930,533	42,990,422
営業収益合計	9,930,533	42,990,422
営業費用		
支払利息	-	30
受託者報酬	7,079	30,728
委託者報酬	171,077	738,462
その他費用	1,343	6,071
営業費用合計	179,499	775,291
営業利益	9,751,034	42,215,131
経常利益	9,751,034	42,215,131
当期純利益	9,751,034	42,215,131
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	126,791	2,651,622
期首剰余金又は期首欠損金()	2,728,547	21,686,881
剰余金増加額又は欠損金減少額	538,647	5,211,716
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	538,647	5,211,716
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,121,224	15,044,872
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	29,121,224	15,044,872
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	21,686,881	8,043,472

(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3期	
	自 2020年11月17日	至 2021年5月14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11月14日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2020年11月16日としております。このため、当計算期間は179日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在
1. 1 期首元本額	8,478,101円	146,694,517円
期中追加設定元本額	140,458,220円	342,186,288円
期中一部解約元本額	2,241,804円	41,376,227円
2. 計算期間末日における受益権の総数	146,694,517口	447,504,578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21,686,881円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2020年5月15日 至 2020年11月16日	自 2020年11月17日 至 2021年5月14日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(8,806,718円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は8,806,718円(1万口当たり600.34円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(39,563,539円)、投資信託約款に規定される収益調整金(19,421,161円)及び分配準備積立金(7,444,190円)より分配対象額は66,428,890円(1万口当たり1,484.43円)であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2020年11月17日 至 2021年5月14日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2021年5月14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2期	第3期
	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,879,972	42,347,948
合計	9,879,972	42,347,948

（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2期	第3期
2020年11月16日現在	2021年5月14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3期
自 2020年11月17日
至 2021年5月14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2期	第3期
	2020年11月16日現在	2021年5月14日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8522円 (8,522円)	1.0180円 (10,180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・グローバルREITインデックス・マザーファンド	171,432,418	455,495,934	
親投資信託受益証券 合計			455,495,934	
合計			455,495,934	

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・グローバルREITインデックス・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・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

【純資産額計算書】

2021年5月31日

資産総額	193,565,325円
負債総額	60,457円
純資産総額(-)	193,504,868円
発行済数量	189,351,948口
1単位当たり純資産額(/)	1.0219円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	40,883,431,199円
負債総額	111,007,875円
純資産総額(-)	40,772,423,324円
発行済数量	14,766,477,805口
1単位当たり純資産額(/)	2.7611円

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	475,185,207円
負債総額	595,622円
純資産総額(-)	474,589,585円
発行済数量	448,779,507口
1単位当たり純資産額(/)	1.0575円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)」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
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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(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、）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

2021年5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

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2021年5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	45	95,256
追加型株式投資信託	747	20,710,140
株式投資信託 合計	792	20,805,395
単位型公社債投資信託	63	187,956
追加型公社債投資信託	14	1,510,584
公社債投資信託 合計	77	1,698,540
総合計	869	22,503,935

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（2020年4月1日から2021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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		2,741		4,860
有価証券		22,167		333
前払費用		205		237
未収委託者報酬		10,847		13,150
未収収益		63		49
関係会社短期貸付金		-		18,700
その他		62		207
流動資産計		36,088		37,539
固定資産				
有形固定資産	1	217	1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183

長期差入保証金	1,069	1,068
繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2	2
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
固定負債		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
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	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32

旅費交通費	154	37
租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31 日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	78	109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	利益剰余金	
				剰余金		
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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	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	利益剰余金	
				剰余金		
繰越利益	剰余金					

当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,175	1,175	1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 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。

(追加情報)

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適

用指針第19号(2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」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」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

(注記に関する表示方法の変更)

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」(企業会計基準第31号 2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という)が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、(重要な会計上の見積り)を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第6項及び第7項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金	3,397百万円	3,473百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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。

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020年 6月24日

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

2021年6月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23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、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、関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 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。

() 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。

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表	計上額	時価	差額
投資有価証券(1)		60	60	-
資産合計		60	60	-

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(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、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	85	55	30
(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

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

(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いません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

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181百万円、当事業年度186百万円であります。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	71	453
繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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（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。

当事業年度（2021年3月31日）

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

（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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

（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、記載を省略していません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 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せん。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
----	--------	-----	---------------	-------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注4)	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研 ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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。

(注5)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
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。

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。）。

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。）。

通常の実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。

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。

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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】

	名 称	資本金の額単位： 百万円 (2020年3月末日現 在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円 (2020年07月27日現 在)	(注6)	

販売会社	農林中央金庫	4,040,198	(注10)	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注6)	
	北海道信用農業協同組合連合会	*96,273	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。	
	岩手県信用農業協同組合連合会	*19,463		
	茨城県信用農業協同組合連合会	*25,549		
	埼玉県信用農業協同組合連合会	*139,440		
	東京都信用農業協同組合連合会	*78,204		
	神奈川県信用農業協同組合連合会	*194,885		
	長野県信用農業協同組合連合会	*54,858		
	新潟県信用農業協同組合連合会	*56,296		
	石川県信用農業協同組合連合会	*17,468		
	岐阜県信用農業協同組合連合会	*70,118		
	静岡県信用農業協同組合連合会	*111,302		
	愛知県信用農業協同組合連合会	*198,402		
	三重県信用農業協同組合連合会	*39,124		
	福井県信用農業協同組合連合会	*23,372		
	滋賀県信用農業協同組合連合会	*34,697		
	京都府信用農業協同組合連合会	*32,681		
	大阪府信用農業協同組合連合会	*140,690		
	兵庫県信用農業協同組合連合会	*170,546		
和歌山県信用農業協同組合連合会	*51,799			
	*80,200			

広島県信用農業協同組合連合会		
山口県信用農業協同組合連合会	*35,542	
徳島県信用農業協同組合連合会	*32,546	
香川県信用農業協同組合連合会	*27,537	
佐賀県信用農業協同組合連合会	*28,130	
大分県信用農業協同組合連合会	*15,599	
岩手中央農業協同組合	*4,441	
岩手江刺農業協同組合	*2,370	
仙台農業協同組合	*3,434	
みやぎ亘理農業協同組合	*1,554	
みやぎ登米農業協同組合	*6,459	
新みやぎ農業協同組合	*2,941	
いしのまき農業協同組合	*4,497	
みやぎ仙南農業協同組合	*4,041	
秋田しんせい農業協同組合	*5,632	
山形農業協同組合	*4,080	
さがえ西村山農業協同組合	*3,757	
山形おきたま農業協同組合	*4,965	
鶴岡市農業協同組合	*1,488	
庄内たがわ農業協同組合	*4,381	
ふくしま未来農業協同組合	*15,932	
福島さくら農業協同組合	*8,676	
北つくば農業協同組合	*3,382	
はが野農業協同組合	*3,648	
那須南農業協同組合	*1,157	
前橋市農業協同組合	*4,163	
高崎市農業協同組合	*2,001	
佐波伊勢崎農業協同組合	*2,545	
邑楽館林農業協同組合	*2,814	
さいたま農業協同組合	*8,181	
あさか野農業協同組合	*871	
いるま野農業協同組合	*5,963	
埼玉中央農業協同組合	*2,335	
ちちぶ農業協同組合	*1,603	

埼玉ひびきの農業協同組合	*1,849
くまがや農業協同組合	*2,768
ほくさい農業協同組合	*3,181
越谷市農業協同組合	*1,568
南彩農業協同組合	*2,847
埼玉みずほ農業協同組合	*1,437
さいかつ農業協同組合	*1,864
ふかや農業協同組合	*1,613
君津市農業協同組合	*3,639
山武郡市農業協同組合	*4,778
千葉みらい農業協同組合	*2,289
市川市農業協同組合	*3,358
町田市農業協同組合	*1,033
マインズ農業協同組合	*1,795
横浜農業協同組合	*12,402
セレサ川崎農業協同組合	*2,516
よこすか葉山農業協同組合	*1,454
さがみ農業協同組合	*5,363
湘南農業協同組合	*1,998
秦野市農業協同組合	*1,775
かながわ西湘農業協同組合	*2,531
厚木市農業協同組合	*2,589
県央愛川農業協同組合	*510
相模原市農業協同組合	*881
神奈川つくい農業協同組合	*850
長野八ヶ岳農業協同組合	*4,279
佐久浅間農業協同組合	*6,627
信州うえだ農業協同組合	*4,273
信州諏訪農業協同組合	*6,454
上伊那農業協同組合	*8,124
みなみ信州農業協同組合	*4,519
松本ハイランド農業協同組合	*6,213
洗馬農業協同組合	*890
あづみ農業協同組合	*4,238
大北農業協同組合	*3,263
グリーン長野農業協同組合	*3,699
中野市農業協同組合	*2,504
ながの農業協同組合	*12,921
北越後農業協同組合	*3,088
胎内市農業協同組合	*1,330

新潟みらい農業協同組合	*4,830
新津さつき農業協同組合	*1,596
越後中央農業協同組合	*5,313
にいがた南蒲農業協同組合	*4,950
越後ながおか農業協同組合	*5,506
越後おぢや農業協同組合	*2,421
北魚沼農業協同組合	*2,744
十日町農業協同組合	*2,815
柏崎農業協同組合	*3,489
えちご上越農業協同組合	*7,920
ひすい農業協同組合	*1,264
にいがた岩船農業協同組合	*2,498
佐渡農業協同組合	*2,505
新潟市農業協同組合	*3,055
黒部市農業協同組合	*1,307
加賀農業協同組合	*1,966
小松市農業協同組合	*1,744
能美農業協同組合	*1,249
金沢中央農業協同組合	*1,058
金沢市農業協同組合	*3,158
石川かほく農業協同組合	*1,887
はくい農業協同組合	*1,340
能登わかば農業協同組合	*2,667
おおぞら農業協同組合	*1,217
ぎふ農業協同組合	*7,218
西美濃農業協同組合	*4,658
いび川農業協同組合	*2,073
めぐみの農業協同組合	*4,704
陶都信用農業協同組合	*1,607
東美濃農業協同組合	*2,624
飛騨農業協同組合	*6,368
伊豆太陽農業協同組合	*1,818
三島函南農業協同組合	*1,049
伊豆の国農業協同組合	*913
あいら伊豆農業協同組合	*915
南駿農業協同組合	*3,158
御殿場農業協同組合	*1,234
富士市農業協同組合	*1,492
富士宮農業協同組合	*945
清水農業協同組合	*2,981

静岡市農業協同組合	*1,902
大井川農業協同組合	*3,433
ハイナン農業協同組合	*857
掛川市農業協同組合	*746
遠州夢咲農業協同組合	*3,579
遠州中央農業協同組合	*3,301
とぴあ浜松農業協同組合	*3,715
三ヶ日町農業協同組合	*297
なごや農業協同組合	*2,454
尾張中央農業協同組合	*2,118
西春日井農業協同組合	*157
あいち尾東農業協同組合	*1,192
愛知北農業協同組合	*747
愛知西農業協同組合	*1,617
あいち海部農業協同組合	*1,070
あいち知多農業協同組合	*7,183
あいち中央農業協同組合	*3,468
西三河農業協同組合	*1,301
あいち三河農業協同組合	*1,114
あいち豊田農業協同組合	*1,809
愛知東農業協同組合	*971
蒲郡市農業協同組合	*296
ひまわり農業協同組合	*1,410
愛知みなみ農業協同組合	*1,346
豊橋農業協同組合	*2,515
三重北農業協同組合	*6,208
鈴鹿農業協同組合	*1,628
津安芸農業協同組合	*2,189
伊勢農業協同組合	*4,367
伊賀ふるさと農業協同組合	*2,846
福井県農業協同組合	*17,420
越前たけふ農業協同組合	*2,762
甲賀農業協同組合	*2,478
グリーン近江農業協同組合	*4,432
東びわこ農業協同組合	*3,480
北びわこ農業協同組合	*1,934
北大阪農業協同組合	*1,887
茨木市農業協同組合	*1,237
大阪泉州農業協同組合	*2,009
いずみの農業協同組合	*2,884

堺市農業協同組合	*1,187
大阪南農業協同組合	*3,822
グリーン大阪農業協同組合	*1,507
大阪中河内農業協同組合	*4,263
北河内農業協同組合	*2,635
大阪市農業協同組合	*1,919
兵庫六甲農業協同組合	*5,831
あかし農業協同組合	*423
兵庫南農業協同組合	*3,763
みのり農業協同組合	*4,439
兵庫みらい農業協同組合	*3,483
加古川市南農業協同組合	*527
兵庫西農業協同組合	*12,416
相生市農業協同組合	*101
ハリマ農業協同組合	*968
たじま農業協同組合	*4,526
丹波ひかみ農業協同組合	*2,286
丹波ささやま農業協同組合	*2,200
淡路日の出農業協同組合	*1,879
あわじ島農業協同組合	*3,970
奈良県農業協同組合	*9,389
わかやま農業協同組合	*4,466
ながみね農業協同組合	*2,006
紀の里農業協同組合	*3,586
紀北川上農業協同組合	*4,269
ありだ農業協同組合	*2,098
紀州農業協同組合	*3,667
紀南農業協同組合	*4,717
みくまの農業協同組合	*1,002
鳥取いなば農業協同組合	*6,061
鳥取中央農業協同組合	*3,875
鳥取西部農業協同組合	*5,133
島根県農業協同組合	*22,681
晴れの国岡山農業協同組合	*25,314
広島市農業協同組合	*6,724
佐伯中央農業協同組合	*1,286
広島中央農業協同組合	*3,067
福山市農業協同組合	*5,798
三次農業協同組合	*1,879
山口県農業協同組合	*2,362

徳島市農業協同組合	*3,026	
香川県農業協同組合	*26,469	
越智今治農業協同組合	*6,417	
佐賀県農業協同組合	*22,378	
唐津農業協同組合	*4,543	
伊万里市農業協同組合	*2,427	
宮崎中央農業協同組合	*5,828	
延岡農業協同組合	*1,469	
下野農業協同組合	**2,043	
東京中央農業協同組合	*1,156	
大阪北部農業協同組合	*1,652	
みなみ魚沼農業協同組合	**2,096	
とうかつ中央農業協同組合	*1,657	
みえなか農業協同組合	*2,116	
レーク滋賀農業協同組合	**2,424	
広島北部農業協同組合	**2,377	
長崎県央農業協同組合	**5,715	
長崎西彼農業協同組合	*3,354	
那須野農業協同組合	**3,884	
もがみ中央農業協同組合	***2,803	
庄内みどり農業協同組合	***5,414	
市原市農業協同組合	****2,453	

*出資金を記載しています。(2019年3月末日現在)

**出資金を記載しています。(2020年2月末日現在)

***出資金を記載しています。(2020年3月末日現在)

****出資金を記載しています。(2019年12月末日現在)

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

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）
2021年1月28日	臨時報告書
2021年2月9日	有価証券届出書、有価証券報告書
2021年4月28日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未 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の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021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

2021年6月18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 竹内 知明 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」に掲げられているグローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)の2020年11月17日から2021年5月14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、グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)の2021年5月14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。

独立監査人の監査報告書

2021年6月18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 竹内 知明 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」に掲げられているグローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2020年11月17日から2021年5月14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、グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2021年5月14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。