

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年10月5日提出
【計算期間】	第16計算期間中 (自 2021年1月13日 至 2021年7月12日)
【ファンド名】	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)
【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。

1 【ファンドの運用状況】

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）】

(1) 【投資状況】（2021年7月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	6,887,769,214	99.11
内 日本	6,887,769,214	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	62,076,449	0.89
純資産総額	6,949,845,663	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) 【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6計算期間末 (2012年1月10日)	884,929,811	884,929,811	0.8535	0.8535
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,295,359,257	1,295,359,257	1.0521	1.0521
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,780,966,415	1,780,966,415	1.3008	1.3008
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,254,707,121	2,254,707,121	1.5471	1.5471
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,390,744,550	2,390,744,550	1.4830	1.4830
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715

第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
2020年7月末日	5,134,594,622	-	1.6669	-
8月末日	5,324,512,208	-	1.7093	-
9月末日	5,394,657,015	-	1.6941	-
10月末日	5,393,131,792	-	1.6574	-
11月末日	5,678,682,071	-	1.7277	-
12月末日	5,871,604,606	-	1.7658	-
第15計算期間末 (2021年1月12日)	5,838,750,574	5,838,750,574	1.7702	1.7702
2021年1月末日	5,899,343,635	-	1.7794	-
2月末日	6,052,978,221	-	1.8097	-
3月末日	6,378,204,255	-	1.8784	-
4月末日	6,537,899,067	-	1.9024	-
5月末日	6,677,948,829	-	1.9247	-
6月末日	6,842,283,440	-	1.9468	-
7月末日	6,949,845,663	-	1.9591	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
2021年1月13日～ 2021年7月12日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	6.7
第7計算期間	23.3
第8計算期間	23.6
第9計算期間	18.9

第10計算期間	4.1
第11計算期間	4.9
第12計算期間	5.4
第13計算期間	4.2
第14計算期間	12.2
第15計算期間	0.4
2021年1月13日～ 2021年7月12日	10.8

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	225,453,839,815	98.68
内 ユーロ	91,202,465,995	39.92
内 シンガポール	920,741,157	0.40
内 マレーシア	1,040,858,231	0.46
内 イスラエル	999,506,591	0.44
内 ノルウェー	533,086,287	0.23
内 スウェーデン	658,880,914	0.29
内 デンマーク	1,086,569,430	0.48
内 イギリス	14,821,826,997	6.49
内 ポーランド	1,344,160,849	0.59
内 カナダ	4,403,294,042	1.93
内 アメリカ	102,285,055,103	44.77
内 メキシコ	1,590,996,268	0.70
内 オーストラリア	4,566,397,951	2.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,006,878,826	1.32
純資産総額	228,460,718,641	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	686,322,562	0.30
内 日本	686,322,562	0.30

(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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	28,848,815,990	88.38
内 日本	28,848,815,990	88.38
地方債証券	1,775,623,600	5.44
内 日本	1,775,623,600	5.44
特殊債券	730,943,100	2.24
内 日本	730,943,100	2.24
社債券	1,029,008,500	3.15
内 日本	1,029,008,500	3.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	257,290,713	0.79
純資産総額	32,641,681,903	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。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	84,590,346,885	94.10
内 香港	2,861,459,196	3.18
内 シンガポール	6,058,894,612	6.74
内 イギリス	9,061,387,096	10.08
内 オランダ	688,879,471	0.77
内 ベルギー	3,346,579,373	3.72
内 フランス	4,734,132,071	5.27
内 ドイツ	561,508,441	0.62

内 スペイン	442,317,397	0.49
内 カナダ	1,631,861,148	1.82
内 アメリカ	42,643,846,430	47.44
内 オーストラリア	11,806,750,172	13.13
内 ニューージーランド	752,731,478	0.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,300,249,337	5.90
純資産総額	89,890,596,222	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	600,083,102	0.67
内 日本	600,083,102	0.67
為替予約取引(売建)	8,857,176	0.01
内 日本	8,857,176	0.01

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

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

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

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	119,621,966,600	96.92
内 日本	119,621,966,600	96.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,803,491,044	3.08
純資産総額	123,425,457,644	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,578,200,000	2.09
内 日本	2,578,200,000	2.09

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

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,951,431,206	77.37
内 カナダ	15,824,055	0.41
内 アメリカ	2,935,607,151	76.95
ハイブリッド優先証券	633,507,342	16.61
内 アメリカ	633,507,342	16.61
投資証券	19,442,660	0.51
内 アメリカ	19,442,660	0.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	210,366,283	5.51
純資産総額	3,814,747,491	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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,351,096,433	94.32
内 スウェーデン	7,245,596	0.51
内 イギリス	269,503,347	18.81
内 オランダ	139,356,822	9.73
内 フランス	271,551,182	18.96
内 ドイツ	276,566,444	19.31
内 スイス	267,662,674	18.69
内 スペイン	21,435,310	1.50

	内 イタリア	97,775,058	6.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		81,359,992	5.68
純資産総額		1,432,456,425	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。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		667,554,010	95.38
	内 韓国	177,442,634	25.35
	内 中国	40,037,419	5.72
	内 台湾	170,916,838	24.42
	内 香港	72,579,986	10.37
	内 シンガポール	20,327,483	2.90
	内 オーストラリア	186,249,650	26.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		32,310,434	4.62
純資産総額		699,864,444	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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		15,422,903,650	98.91
	内 日本	15,422,903,650	98.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		170,625,620	1.09
純資産総額		15,593,529,270	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。

(参考情報) 運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

2021年7月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	19,591円
純資産総額	69億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	3.0%
6カ月間	10.1%
1年間	17.5%
3年間	20.5%
5年間	30.3%
設定来	95.9%



※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4期 10年1月	第5期 11年1月	第6期 12年1月	第7期 13年1月	第8期 14年1月	第9期 15年1月	第10期 16年1月	第11期 17年1月	第12期 18年1月	第13期 19年1月	第14期 20年1月	第15期 21年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	285	24.6%	日本円	50.9%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.4%	
外国債券	837	24.4%	米ドル	26.1%	最終利回り(%)	日立	日本	0.3%	
外国リート等	135	15.3%	ユーロ	12.8%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.3%	
国内リート・先物	47	14.8%	英ポンド	3.6%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.3%	
国内株式	119	9.7%	豪ドル	2.6%	債券格付別構成	武田薬品	日本	0.2%	
外国株式	153	8.1%	シンガポール・ドル	1.2%	AAA	85.7%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.2%
			カナダドル	0.8%	AA	6.3%	日本ビルファンド	日本	1.0%
			香港ドル	0.5%	A	6.4%	GLP投資法人	日本	0.8%
			スイス・フラン	0.4%	BBB	-	野村不動産マスターF	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.4%	その他	1.1%	BB以下・無格付	1.6%	日本プロジスリート	日本	0.8%
合計	1,576	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.3%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.6%保有しております。

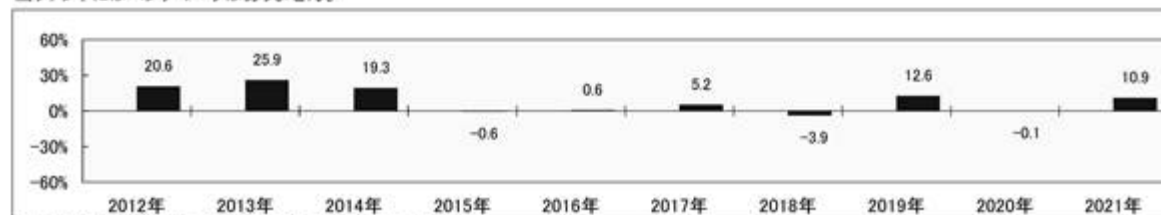
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2021年は7月30日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

(1) 【投資状況】(2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,792,799,190	99.11
内 日本	7,792,799,190	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	70,249,375	0.89
純資産総額	7,863,048,565	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) 【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6計算期間末 (2012年1月10日)	860,992,412	860,992,412	0.8062	0.8062
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,272,367,641	1,272,367,641	1.0192	1.0192
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,919,665,131	1,919,665,131	1.3193	1.3193
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,724,473,332	2,724,473,332	1.5976	1.5976
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,855,754,201	2,855,754,201	1.5254	1.5254
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
2020年7月末日	5,753,612,439	-	1.7277	-
8月末日	5,987,989,326	-	1.7904	-

9月末日	6,024,705,714	-	1.7681	-
10月末日	5,951,977,752	-	1.7242	-
11月末日	6,223,789,004	-	1.8201	-
12月末日	6,462,053,944	-	1.8700	-
第15計算期間末 (2021年1月12日)	6,484,800,717	6,484,800,717	1.8830	1.8830
2021年1月末日	6,520,006,792	-	1.8897	-
2月末日	6,718,642,714	-	1.9373	-
3月末日	7,142,468,662	-	2.0287	-
4月末日	7,288,255,621	-	2.0582	-
5月末日	7,474,051,912	-	2.0864	-
6月末日	7,740,397,710	-	2.1160	-
7月末日	7,863,048,565	-	2.1273	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
2021年1月13日～ 2021年7月12日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	8.6
第7計算期間	26.4
第8計算期間	29.4
第9計算期間	21.1
第10計算期間	4.5
第11計算期間	6.7
第12計算期間	7.9
第13計算期間	6.2

第14計算期間	14.7
第15計算期間	0.3
2021年1月13日～ 2021年7月12日	13.3

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考情報)運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

2021年7月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	21,273円
純資産総額	78億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	0.5%
3か月間	3.4%
6か月間	12.6%
1年間	23.1%
3年間	22.9%
5年間	37.8%
設定来	112.7%

※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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第4期	第5期	第6期	第7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
	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国リート等	135	17.7%	日本円	51.1%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.7%	
国内リート・先物	47	16.5%	米ドル	28.0%	最終利回り(%)	日立	日本	0.6%	
国内債券	285	16.4%	ユーロ	10.5%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.6%	
外国債券	837	16.3%	英ポンド	3.4%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.5%	
国内株式	119	16.1%	豪ドル	2.7%	債券格付別構成	武田薬品	日本	0.4%	
外国株式	153	13.4%	シンガポール・ドル	1.3%	AAA	85.7%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.4%
			カナダドル	0.7%	AA	6.3%	日本ビルファンド	日本	1.1%
			香港ドル	0.6%	A	6.4%	GLP投資法人	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.6%	BBB	-	野村不動産マスターF	日本	0.9%
コール・ローン、その他		3.8%	その他	1.0%	BB以下・無格付	1.6%	日本プロロジスリート	日本	0.8%
合計	1,576	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.9%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.6%保有しております。

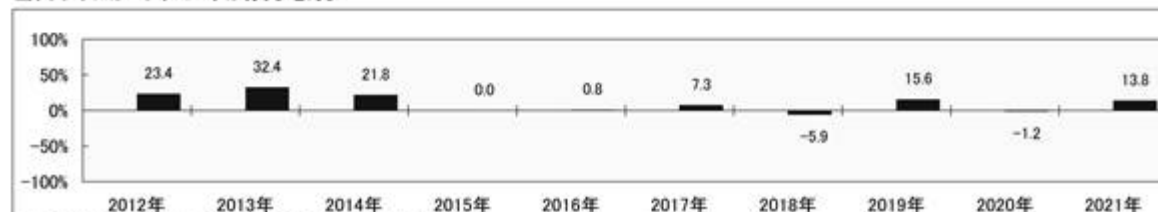
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2021年は7月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】

(1) 【投資状況】 (2021年7月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	9,311,769,849	99.11
内 日本	9,311,769,849	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	83,946,054	0.89
純資産総額	9,395,715,903	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) 【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6計算期間末 (2012年1月10日)	636,326,055	636,326,055	0.7304	0.7304
第7計算期間末 (2013年1月10日)	997,507,134	997,507,134	0.9581	0.9581
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,528,562,866	1,528,562,866	1.3144	1.3144
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,263,159,704	2,263,159,704	1.6365	1.6365
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,808,604,084	2,808,604,084	1.5507	1.5507
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
2020年7月末日	6,082,188,151	-	1.7918	-
8月末日	6,447,822,514	-	1.8838	-
9月末日	6,430,198,971	-	1.8508	-
10月末日	6,316,575,004	-	1.7959	-
11月末日	6,766,884,771	-	1.9289	-

12月末日	7,172,062,894	-	1.9969	-
第15計算期間末 (2021年1月12日)	7,237,633,493	7,237,633,493	2.0216	2.0216
2021年1月末日	7,291,917,951	-	2.0262	-
2月末日	7,616,595,946	-	2.1011	-
3月末日	8,220,034,138	-	2.2268	-
4月末日	8,465,603,734	-	2.2662	-
5月末日	8,882,523,618	-	2.3036	-
6月末日	9,233,039,897	-	2.3462	-
7月末日	9,395,715,903	-	2.3565	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
2021年1月13日～ 2021年7月12日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	11.3
第7計算期間	31.2
第8計算期間	37.2
第9計算期間	24.5
第10計算期間	5.2
第11計算期間	9.2
第12計算期間	11.1
第13計算期間	8.5
第14計算期間	18.5
第15計算期間	0.8

2021年1月13日～ 2021年7月12日	17.1
---------------------------	------

(参考)マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考情報)運用実績

●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

2021年7月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	23,565円
純資産総額	93億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	4.0%
6カ月間	16.3%
1年間	31.5%
3年間	27.8%
5年間	50.1%
設定来	135.7%

※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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第4期	第5期	第6期	第7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
	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月	21年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	119	24.2%	日本円	51.3%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	1.0%	
外国リート等	135	21.9%	米ドル	30.5%	最終利回り(%)	日立	日本	0.9%	
外国株式	153	20.2%	ユーロ	7.1%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%	
国内リート・先物	47	19.8%	英ポンド	3.3%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.8%	
国内債券	285	4.9%	豪ドル	3.0%	債券格付別構成	武田薬品	日本	0.6%	
外国債券	837	4.9%	シンガポール・ドル	1.4%	AAA	85.7%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.6%
			スイス・フラン	0.9%	AA	6.3%	日本ビルファンド	日本	1.3%
			香港ドル	0.8%	A	6.4%	GLP投資法人	日本	1.1%
			カナダ・ドル	0.6%	BBB	-	野村不動産マスターF	日本	1.1%
コール・ローン、その他		4.4%	その他	0.9%	BB以下・無格付	1.6%	日本プロジスリート	日本	1.0%
合計	1,576	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	10.4%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.6%保有しております。

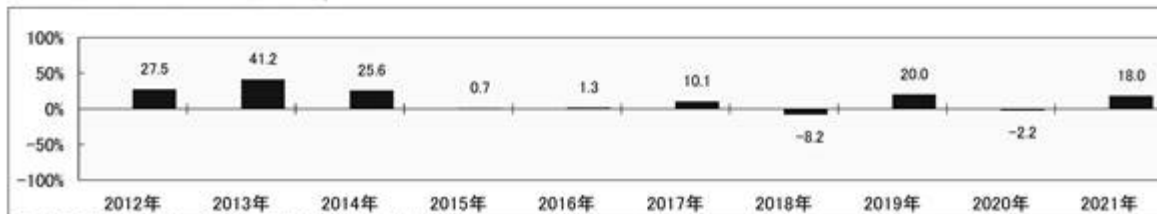
※格付別構成については、R&I, JCR, Moody's, S&P, Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2021年は7月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

2 【設定及び解約の実績】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	379,299,436	87,980,745
第7計算期間	309,871,850	115,412,495
第8計算期間	351,397,372	213,512,755
第9計算期間	438,028,259	349,751,949
第10計算期間	345,342,005	190,621,495
第11計算期間	389,459,803	224,474,896
第12計算期間	458,208,043	289,727,307
第13計算期間	575,990,631	232,603,369
第14計算期間	809,239,523	304,172,889
第15計算期間	963,521,848	459,114,213
2021年1月13日～ 2021年7月12日	424,560,202	208,555,284

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	330,374,277	111,886,717
第7計算期間	315,959,783	135,527,444
第8計算期間	518,832,342	312,242,524
第9計算期間	501,213,562	250,896,906
第10計算期間	501,645,807	334,815,579
第11計算期間	489,108,988	304,974,316
第12計算期間	577,484,738	415,195,786
第13計算期間	682,462,389	295,483,585
第14計算期間	853,612,726	397,196,903
第15計算期間	998,812,762	616,961,375
2021年1月13日～ 2021年7月12日	443,426,805	235,018,064

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	304,734,938	88,735,227
第7計算期間	263,861,578	93,971,400

第8計算期間	359,002,036	237,170,149
第9計算期間	458,619,078	238,638,593
第10計算期間	698,613,794	270,347,551
第11計算期間	433,420,891	252,225,036
第12計算期間	541,348,837	363,638,097
第13計算期間	676,061,653	274,586,229
第14計算期間	898,116,398	365,651,278
第15計算期間	1,060,242,411	584,120,737
2021年1月13日 ~ 2021年7月12日	576,168,677	216,277,874

3 【ファンドの経理状況】

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年1月13日から2021年7月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,799,886	94,412,296
親投資信託受益証券	5,787,677,732	6,831,599,736
未収入金	5,331,000	2,792,000
流動資産合計	5,874,808,618	6,928,804,032
資産合計	5,874,808,618	6,928,804,032
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,379,643	4,655,252
未払受託者報酬	1,524,940	1,741,673
未払委託者報酬	25,924,802	29,609,015
その他未払費用	228,659	261,158
流動負債合計	36,058,044	36,267,098
負債合計	36,058,044	36,267,098
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,298,446,758	1 3,514,451,676
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,540,303,816	3,378,085,258
(分配準備積立金)	794,784,674	747,640,482
元本等合計	5,838,750,574	6,892,536,934
純資産合計	5,838,750,574	6,892,536,934
負債純資産合計	5,874,808,618	6,928,804,032

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
営業収益		
受取利息	147	2
有価証券売買等損益	282,189,134	680,216,004
営業収益合計	282,188,987	680,216,006
営業費用		
支払利息	11,573	8,033
受託者報酬	1,307,459	1,741,673
委託者報酬	1 22,227,472	1 29,609,015
その他費用	196,288	261,200
営業費用合計	23,742,792	31,619,921
営業利益又は営業損失()	305,931,779	648,596,085
経常利益又は経常損失()	305,931,779	648,596,085
中間純利益又は中間純損失()	305,931,779	648,596,085
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	28,867,700	21,230,396
期首剰余金又は期首欠損金()	2,131,406,329	2,540,303,816
剰余金増加額又は欠損金減少額	320,393,634	372,022,199
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	320,393,634	372,022,199
剰余金減少額又は欠損金増加額	197,183,532	161,606,446
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	197,183,532	161,606,446
中間剰余金又は中間欠損金()	1,977,552,352	3,378,085,258

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	2,794,039,123円	3,298,446,758円
期中追加設定元本額	963,521,848円	424,560,202円
期中一部解約元本額	459,114,213円	208,555,284円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,298,446,758口	3,514,451,676口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	2,935,603円		3,951,524円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

(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

前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,7702円 (17,702円)	1,9612円 (19,612円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	808,209,810	565,453,319
コール・ローン	1,190,976,152	579,915,192
国債証券	210,809,825,116	223,953,312,956
派生商品評価勘定	3,923,781	-
未収利息	1,316,013,992	1,265,540,246
前払費用	39,582,701	22,835,627
流動資産合計	214,168,531,552	226,387,057,340
資産合計	214,168,531,552	226,387,057,340
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,029,163	2,896,260
未払金	398,271	1,951,870
未払解約金	64,770,905	204,048,427
その他未払費用	-	5,940
流動負債合計	67,198,339	208,902,497
負債合計	67,198,339	208,902,497
純資産の部		
元本等		
元本	1 70,827,785,140	72,559,196,854
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	143,273,548,073	153,618,957,989
元本等合計	214,101,333,213	226,178,154,843
純資産合計	214,101,333,213	226,178,154,843
負債純資産合計	214,168,531,552	226,387,057,340

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<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	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	67,069,648,143円	70,827,785,140円
期中追加設定元本額	13,637,218,460円	5,100,799,436円
期中一部解約元本額	9,879,081,463円	3,369,387,722円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス	602,461,239円	516,664,878円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	12,073,691円	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	102,820,108円	89,935,362円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	29,649,083円	26,042,029円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	335,728,560円	313,762,984円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	101,745,014円	161,798,608円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	470,402,250円	499,502,909円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,857,026,512円	2,141,495,803円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	676,573,763円	816,714,483円
D-I's 外国債券インデッ クス	948,935円	973,369円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,138,009円	4,206,442円
iFree 外国債券イン デックス	988,266,664円	1,331,422,461円
iFree 8資産バランス	1,032,007,540円	1,288,379,174円
iFree 年金バランス	73,460,835円	168,670,927円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,824,975,540円	49,280,771,026円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	832,230,744円	897,056,433円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	473,441,226円	537,452,629円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	291,976,212円	341,900,533円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	471,628,775円	544,727,672円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	348,917,972円	410,236,792円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	116,184,508円	147,341,792円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	20,967,274円	25,244,169円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,169,837円	8,365,036円
ダイワつみたてインデックス外国債券	177,823,083円	357,811,537円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,152,607円	3,251,349円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,016,919円	1,182,039円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,041,435円	1,559,838円
ダイワ世界バランスファンド40VA	176,190,863円	172,997,093円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,140,957円	137,923,081円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,233,822,499円	4,065,423,221円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	248,882,370円	244,906,590円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,743,446円	144,305,683円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	32,452,799円	39,295,443円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,015,730,533円	1,884,612,572円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,878,588,200円	5,827,609,550円
ダイワライフスタイル25	33,238,853円	33,269,210円
ダイワライフスタイル50	60,572,925円	64,319,037円
ダイワライフスタイル75	16,593,360円	17,308,590円
計	70,827,785,140円	72,559,196,854円

2.	期末日における受益権の総数	70,827,785,140口	72,559,196,854口
----	---------------	-----------------	-----------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年1月12日 現在				2021年7月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618	383,023,336	-	380,127,076	2,896,260
アメリカ・ドル	475,790,631	-	479,528,400	3,737,769	210,946,059	-	209,379,181	1,566,878
イギリス・ポンド	21,131,788	-	21,277,410	145,622	-	-	-	-
ユーロ	618,374,023	-	616,385,250	1,988,773	172,077,277	-	170,747,895	1,329,382
合計	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618	383,023,336	-	380,127,076	2,896,260

(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)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	3,0228円	3,1172円
(1万口当たり純資産額)	(30,228円)	(31,172円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,467,266	144,903,887
国債証券	22,192,881,490	28,427,155,080
地方債証券	1,557,570,200	1,776,574,200
特殊債券	832,608,000	731,041,900
社債券	927,958,500	928,386,200
未収利息	38,592,254	43,302,129
前払費用	1,516,499	1,717,532
流動資産合計	25,722,594,209	32,053,080,928

資産合計		25,722,594,209	32,053,080,928
負債の部			
流動負債			
未払金		65,432,580	-
未払解約金		2,455,801	4,651,014
流動負債合計		67,888,381	4,651,014
負債合計		67,888,381	4,651,014
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,879,992,868	24,773,940,277
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,774,712,960	7,274,489,637
元本等合計		25,654,705,828	32,048,429,914
純資産合計		25,654,705,828	32,048,429,914
負債純資産合計		25,722,594,209	32,053,080,928

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</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>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首 期首元本額	2020年1月11日 16,028,287,542円	2021年1月13日 19,879,992,868円

期中追加設定元本額	6,073,950,287円	5,041,293,956円
期中一部解約元本額	2,222,244,961円	147,346,547円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投資 家専用)	373,114,786円	559,310,369円
iFree 日本債券イン デックス	1,030,746,206円	2,603,155,025円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,420,708,041円	3,104,329,794円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	7,126,335,088円	7,924,393,523円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,423,063,248円	5,176,127,109円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	1,368,806,867円	1,649,806,006円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	1,101,820,763円	1,315,612,785円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	815,724,660円	990,971,569円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	271,665,036円	356,034,569円
ダイワつみたてインデックス バランス30	422,319,928円	549,617,154円
ダイワつみたてインデックス バランス50	26,998,895円	28,836,524円
ダイワつみたてインデックス バランス70	9,495,392円	11,403,640円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	4,868,661円	7,545,417円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	293,760,030円	297,536,014円
計	190,565,267円	199,260,779円
2. 期末日における受益権の総数	19,879,992,868円	24,773,940,277円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	1,2905円	1,2936円
(1万口当たり純資産額)	(12,905円)	(12,936円)

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,300,839,495	4,525,179,686
コール・ローン	293,597,486	673,035,017
投資証券	71,396,328,391	82,471,598,365
派生商品評価勘定	16,001	1,935
未収入金	139,271,654	579,287,318
未収配当金	240,890,128	324,727,359
流動資産合計	74,370,943,155	88,573,829,680
資産合計	74,370,943,155	88,573,829,680

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	46,840	382
未払金	63,754,018	611,219,056
未払解約金	160,219,000	30,196,000
その他未払費用	-	5,940
流動負債合計	224,019,858	641,421,378
負債合計	224,019,858	641,421,378
純資産の部		
元本等		
元本	1	28,120,093,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	46,026,829,542	61,887,012,705
元本等合計	74,146,923,297	87,932,408,302
純資産合計	74,146,923,297	87,932,408,302
負債純資産合計	74,370,943,155	88,573,829,680

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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	為替予約取引

	<p>個別法に基づき、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、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	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	33,163,733,156円	28,120,093,755円
期中追加設定元本額	539,057,501円	152,842,404円
期中一部解約元本額	5,582,696,902円	2,227,540,562円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREI	24,518,016,919円	22,735,826,193円
T・オープン(毎月分配型)		
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	26,764,856円	25,537,755円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	13,633,448円	10,271,549円

インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型）	11,440,763円	9,150,085円
成長重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	61,279,250円	48,701,652円
6資産バランスファンド（分 配型）	119,337,671円	92,711,424円
6資産バランスファンド（成 長型）	282,534,099円	257,147,248円
りそな ワールド・リート・ ファンド	1,239,966,499円	1,138,572,214円
世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	36,275,419円	26,643,176円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン（奇数月分 配型）	2,798,510円	- 円
常陽3分法ファンド	156,851,444円	121,619,801円
ダイワ資産分散インカムオー プン（奇数月決算型）	37,765,258円	29,880,897円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	325,929,946円	307,073,370円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	396,866,111円	385,829,730円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	526,567,569円	550,772,303円
ライフハーモニー（ダイワ世 界資産分散ファンド）（分配 型）	313,498,363円	261,937,277円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（部分為替ヘッジあ り）	24,036,038円	19,860,137円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（為替ヘッジなし）	26,531,592円	23,860,786円
計	28,120,093,755円	26,045,395,597円
2. 期末日における受益権の総数	28,120,093,755口	26,045,395,597口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年1月12日 現在				2021年7月12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	203,069,257	-	203,053,256	16,001	11,172,854	-	11,172,722	132
アメリカ・ドル	63,797,604	-	63,791,484	6,120	11,172,854	-	11,172,722	132
イギリス・ポンド	139,271,653	-	139,261,772	9,881	-	-	-	-
買 建	203,069,257	-	203,022,417	46,840	11,172,854	-	11,174,275	1,421
アメリカ・ドル	139,271,653	-	139,268,399	3,254	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	8,211,215	-	8,213,018	1,803
ユーロ	63,797,604	-	63,754,018	43,586	2,961,639	-	2,961,257	382
合計	406,138,514	-	406,075,673	30,839	22,345,708	-	22,346,997	1,553

（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)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2,6368円	3,3761円
(1万口当たり純資産額)	(26,368円)	(33,761円)

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,328,335,509	2,761,350,315
投資証券	2 91,762,233,400	120,902,983,000
派生商品評価勘定	124,649,740	84,108,000
未収入金	784,288,170	886,464,173
未収配当金	603,800,856	578,266,790
流動資産合計	96,603,307,675	125,213,172,278
資産合計	96,603,307,675	125,213,172,278
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,200	-

前受金	127,984,000	75,840,000
未払金	658,719,029	1,428,518,312
未払解約金	19,058,000	21,443,000
流動負債合計	805,773,229	1,525,801,312
負債合計	805,773,229	1,525,801,312
純資産の部		
元本等		
元本	1	32,599,135,387
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	63,198,399,059	89,960,557,457
元本等合計	95,797,534,446	123,687,370,966
純資産合計	95,797,534,446	123,687,370,966
負債純資産合計	96,603,307,675	125,213,172,278

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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>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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	35,358,466,590円	32,599,135,387円
期中追加設定元本額	37,389,612,621円	2,668,515,865円
期中一部解約元本額	40,148,943,824円	1,540,837,743円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド (FOFs用)(適格機関投資家 専用)	29,826,184,382円	31,056,616,872円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	12,713,653円	9,344,842円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	10,771,748円	8,597,779円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	55,980,030円	44,489,726円
6資産バランスファンド(分 配型)	110,059,334円	86,212,679円
6資産バランスファンド(成 長型)	260,481,037円	232,909,612円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	33,452,934円	24,816,935円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	1,277,759円	- 円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	34,477,349円	27,304,778円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	299,003,468円	281,965,436円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	365,816,395円	353,955,034円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	487,272,518円	508,100,729円
DCダイワJ-REITアク ティブファンド	334,817,219円	312,948,693円

	ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)	77,108,060円	64,592,372円
	ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)	26,418,611円	20,652,227円
	ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	121,041,776円	103,879,165円
	ダイワ・アクティブリリート・ファンド(年4回決算型)	542,259,114円	590,426,630円
計		32,599,135,387円	33,726,813,509円
2.	期末日における受益権の総数	32,599,135,387口	33,726,813,509口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っておりません。 投資証券 1,001,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っておりません。 投資証券 1,194,800,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2021年1月12日 現在				2021年7月12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	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000	2,511,960,000	-	2,596,200,000	84,240,000
合計	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000	2,511,960,000	-	2,596,200,000	84,240,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.9387円	3.6673円
(1万口当たり純資産額)	(29,387円)	(36,673円)

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	44,929,876	76,826,670
コール・ローン	22,731,207	88,599,132
株式	2,645,193,418	2,969,082,916

ハイブリッド優先証券	471,463,756	667,057,714
投資証券	23,931,896	19,525,064
未収配当金	2,588,753	2,390,139
未収利息	559,222	977,968
流動資産合計	3,211,398,128	3,824,459,603
資産合計	3,211,398,128	3,824,459,603
負債の部		
流動負債		
未払金	2,343,468	19,220,702
未払解約金	518,000	4,440,000
その他未払費用	-	5,940
流動負債合計	2,861,468	23,666,642
負債合計	2,861,468	23,666,642
純資産の部		
元本等		
元本	1 946,303,989	935,810,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,262,232,671	2,864,982,475
元本等合計	3,208,536,660	3,800,792,961
純資産合計	3,208,536,660	3,800,792,961
負債純資産合計	3,211,398,128	3,824,459,603

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(2)ハイブリッド優先証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</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	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	922,190,111円	946,303,989円
期中追加設定元本額	121,921,838円	45,227,273円
期中一部解約元本額	97,807,960円	55,720,776円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,140,495円	5,503,707円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,125,953円	5,041,612円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	116,510,790円	93,802,182円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	19,740,852円	15,447,086円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	20,323,891円	16,278,407円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	132,401,213円	127,594,347円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	242,195,048円	240,464,030円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	401,865,747円	431,679,115円
計	946,303,989円	935,810,486円
2. 期末日における受益権の総数	946,303,989口	935,810,486口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	3.3906円	4.0615円
(1万口当たり純資産額)	(33,906円)	(40,615円)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	33,439,138	18,993,106
コール・ローン	13,703,260	44,106,527
株式	1,255,145,752	1,352,865,419
未収配当金	2,505,399	1,478,701
流動資産合計	1,304,793,549	1,417,443,753
資産合計	1,304,793,549	1,417,443,753
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,779,000	1,342,000
その他未払費用	-	5,940
流動負債合計	2,779,000	1,347,940
負債合計	2,779,000	1,347,940
純資産の部		
元本等		
元本	1 740,519,917	700,196,682
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	561,494,632	715,899,131
元本等合計	1,302,014,549	1,416,095,813
純資産合計	1,302,014,549	1,416,095,813
負債純資産合計	1,304,793,549	1,417,443,753

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<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>	<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	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日

期首元本額	753,612,190円	740,519,917円
期中追加設定元本額	114,473,683円	31,651,008円
期中一部解約元本額	127,565,956円	71,974,243円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	14,138,671円	10,935,306円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	11,985,441円	9,880,281円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	222,883,258円	186,900,415円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	37,983,195円	30,666,960円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	39,060,634円	32,227,272円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	70,482,573円	68,376,384円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	129,181,575円	128,722,349円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	214,804,570円	232,487,715円
計	740,519,917円	700,196,682円
2. 期末日における受益権の総数	740,519,917口	700,196,682口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	1.7582円	2.0224円
(1万口当たり純資産額)	(17,582円)	(20,224円)

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	22,424,990	23,675,435
コール・ローン	4,324,649	2,233,425
株式	698,888,104	665,502,364
派生商品評価勘定	15,604	-
未収入金	39,306,245	377,136
未収配当金	712,842	1,766,886
流動資産合計	765,672,434	693,555,246
資産合計	765,672,434	693,555,246
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,820	-
未払解約金	3,014,000	435,000
その他未払費用	-	5,940
流動負債合計	3,037,820	440,940
負債合計	3,037,820	440,940
純資産の部		
元本等		
元本	1 281,837,347	242,537,291
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金()	480,797,267	450,577,015
元本等合計	762,634,614	693,114,306
純資産合計	762,634,614	693,114,306
負債純資産合計	765,672,434	693,555,246

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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られ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られた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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取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、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</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>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2020年1月11日	2021年1月13日
期首元本額	365,560,068円	281,837,347円
期中追加設定元本額	13,237,838円	9,436,080円
期中一部解約元本額	96,960,559円	48,736,136円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	9,692,362円	7,877,295円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,198,991円	6,771,731円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	157,435,181円	129,942,826円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	26,377,648円	20,994,790円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	26,668,165円	22,381,007円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	9,134,583円	8,667,468円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	16,756,169円	16,336,821円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	27,574,248円	29,565,353円
計	281,837,347円	242,537,291円
2. 期末日における受益権の総数	281,837,347口	242,537,291口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年1月12日 現在				2021年7月12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	14,793,604	-	14,784,000	9,604	-	-	-	-
香港・ドル	14,793,604	-	14,784,000	9,604	-	-	-	-
買 建	10,679,820	-	10,662,000	17,820	-	-	-	-
韓国・ウォン	2,844,000	-	2,850,000	6,000	-	-	-	-
台湾・ドル	7,835,820	-	7,812,000	23,820	-	-	-	-
合計	25,473,424	-	25,446,000	8,216	-	-	-	-

（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)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.7059円	2.8578円
(1万口当たり純資産額)	(27,059円)	(28,578円)

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,345,078	270,809,152
株式	15,882,391,960	15,623,046,240
未収入金	-	136,916,454
未収配当金	27,877,750	22,149,350
流動資産合計	16,130,614,788	16,052,921,196
資産合計	16,130,614,788	16,052,921,196
負債の部		
流動負債		

未払金		19,722,053	40,341,166
未払解約金		9,815,000	7,260,000
流動負債合計		29,537,053	47,601,166
負債合計		29,537,053	47,601,166
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,432,945,076	4,826,647,209
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		10,668,132,659	11,178,672,821
元本等合計		16,101,077,735	16,005,320,030
純資産合計		16,101,077,735	16,005,320,030
負債純資産合計		16,130,614,788	16,052,921,196

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1. 1 期首 期首元本額	2020年1月11日 6,085,455,292円	2021年1月13日 5,432,945,076円

期中追加設定元本額	340,283,342円	181,427,916円
期中一部解約元本額	992,793,558円	787,725,783円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信(季節 節点描)	3,615,424,047円	3,018,001,352円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	25,061,574円	24,095,543円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	25,444,630円	20,952,963円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	22,276,776円	18,741,924円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	408,556,095円	345,252,770円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	68,236,074円	57,038,565円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	70,435,625円	60,254,253円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	203,970,079円	204,962,896円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	373,184,938円	384,910,062円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	620,355,238円	692,436,881円
計	5,432,945,076円	4,826,647,209円
2. 期末日における受益権の総数	5,432,945,076口	4,826,647,209口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年1月12日現在	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2,9636円	3,3160円
(1万口当たり純資産額)	(29,636円)	(33,160円)

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年1月13日から2021年7月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,603,304	111,518,126
親投資信託受益証券	6,428,508,091	7,721,391,863
未収入金	575,000	6,754,000
流動資産合計	6,525,686,395	7,839,663,989
資産合計	6,525,686,395	7,839,663,989
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,017,259	8,416,550
未払受託者報酬	1,695,859	1,947,139
未払委託者報酬	33,918,272	38,943,488
その他未払費用	254,288	291,982
流動負債合計	40,885,678	49,599,159
負債合計	40,885,678	49,599,159
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,443,846,915	1 3,652,255,656
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3,040,953,802	4,137,809,174
(分配準備積立金)	951,666,768	890,271,972
元本等合計	6,484,800,717	7,790,064,830
純資産合計	6,484,800,717	7,790,064,830
負債純資産合計	6,525,686,395	7,839,663,989

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
営業収益		
受取利息	179	3
有価証券売買等損益	503,761,429	920,911,772
営業収益合計	503,761,250	920,911,775
営業費用		
支払利息	13,847	9,334
受託者報酬	1,488,690	1,947,139
委託者報酬	1 29,774,503	1 38,943,488
その他費用	223,516	292,029
営業費用合計	31,500,556	41,191,990
営業利益又は営業損失()	535,261,806	879,719,785
経常利益又は経常損失()	535,261,806	879,719,785
中間純利益又は中間純損失()	535,261,806	879,719,785
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	54,348,289	28,927,165
期首剰余金又は期首欠損金()	2,721,446,375	3,040,953,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	401,186,638	454,821,444
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	401,186,638	454,821,444
剰余金減少額又は欠損金増加額	289,576,488	208,758,692
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	289,576,488	208,758,692
中間剰余金又は中間欠損金()	2,352,143,008	4,137,809,174

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	3,061,995,528円	3,443,846,915円
期中追加設定元本額	998,812,762円	443,426,805円
期中一部解約元本額	616,961,375円	235,018,064円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,443,846,915口	3,652,255,656口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	4,303,920円		5,819,100円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

(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

前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,8830円 (18,830円)	2,1329円 (21,329円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- R E I Tアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年1月13日から2021年7月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	109,605,453	139,423,645
親投資信託受益証券	7,175,520,706	9,246,740,768
未収入金	11,120,000	7,888,000
流動資産合計	7,296,246,159	9,394,052,413
資産合計	7,296,246,159	9,394,052,413
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,385,268	10,997,770
未払受託者報酬	1,831,327	2,250,893
未払委託者報酬	42,121,458	51,771,719
その他未払費用	274,613	337,549
流動負債合計	58,612,666	65,357,931
負債合計	58,612,666	65,357,931
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,580,161,955	1 3,940,052,758
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3,657,471,538	5,388,641,724
(分配準備積立金)	1,208,632,750	1,140,318,535
元本等合計	7,237,633,493	9,328,694,482
純資産合計	7,237,633,493	9,328,694,482
負債純資産合計	7,296,246,159	9,394,052,413

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
営業収益		
受取利息	193	3
有価証券売買等損益	761,033,088	1,336,121,062
営業収益合計	761,032,895	1,336,121,065
営業費用		
支払利息	15,233	11,143
受託者報酬	1,570,996	2,250,893
委託者報酬	1 36,134,280	1 51,771,719
その他費用	235,920	337,605
営業費用合計	37,956,429	54,371,360
営業利益又は営業損失()	798,989,324	1,281,749,705
経常利益又は経常損失()	798,989,324	1,281,749,705
中間純利益又は中間純損失()	798,989,324	1,281,749,705
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	81,181,505	38,537,940
期首剰余金又は期首欠損金()	3,223,357,246	3,657,471,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	475,240,979	710,994,727
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	475,240,979	710,994,727
剰余金減少額又は欠損金増加額	340,295,784	223,036,306
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	340,295,784	223,036,306
中間剰余金又は中間欠損金()	2,640,494,622	5,388,641,724

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	3,104,040,281円	3,580,161,955円
期中追加設定元本額	1,060,242,411円	576,168,677円
期中一部解約元本額	584,120,737円	216,277,874円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,580,161,955口	3,940,052,758口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日	自 2021年1月13日	至 2021年7月12日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	6,260,596円		8,998,670円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
-----------------	--

(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

前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0216円 (20,216円)	2,3677円 (23,677円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- R E I Tアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

4 【委託会社等の概況】

(1) 【資本金の額】

2021年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 【事業の内容及び営業の状況】

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7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	52	122,243
追加型株式投資信託	749	20,557,425
株式投資信託 合計	801	20,679,668
単位型公社債投資信託	69	203,809
追加型公社債投資信託	14	1,486,763
公社債投資信託 合計	83	1,690,573
総合計	884	22,370,241

(3) 【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。

5 【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	2,3,530	2,3,617
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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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
	其他有価 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おりません。

（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よう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ます。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月12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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)の2021年1月13日から2021年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2021年1月13日から2021年7月12日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月12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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2021年1月13日から2021年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月13日から2021年7月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月12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
--------------------	-------	-------	---

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2021年1月13日から2021年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月13日から2021年7月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。