

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年10月5日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて、5,000億円を上限とし、合計で1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

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

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

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

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

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2021年10月6日から2022年4月4日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。  
一般社団法人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。

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

## 商品分類表〈各ファンド共通〉

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表〈各ファンド共通〉

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

ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

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

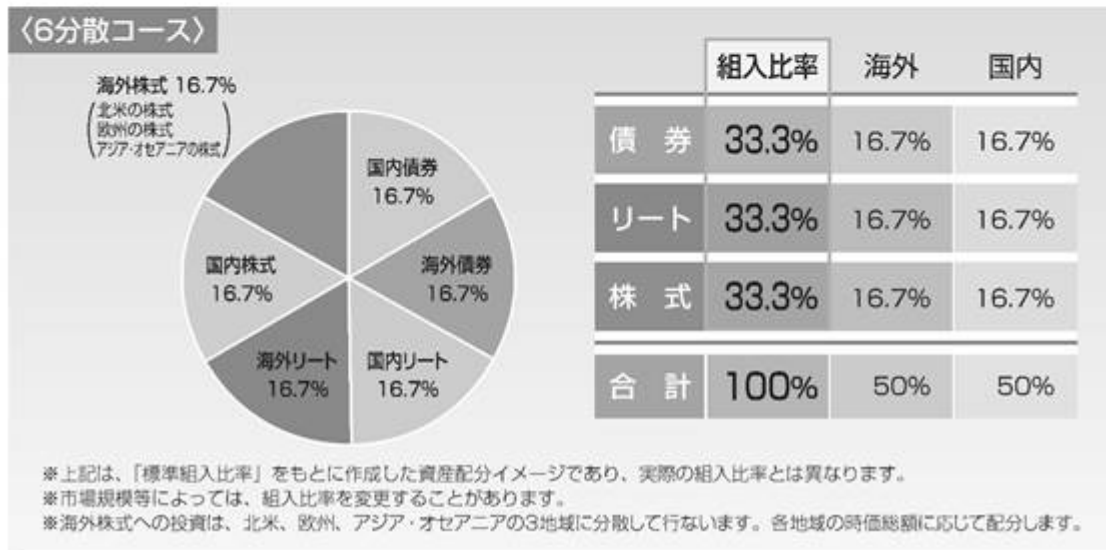
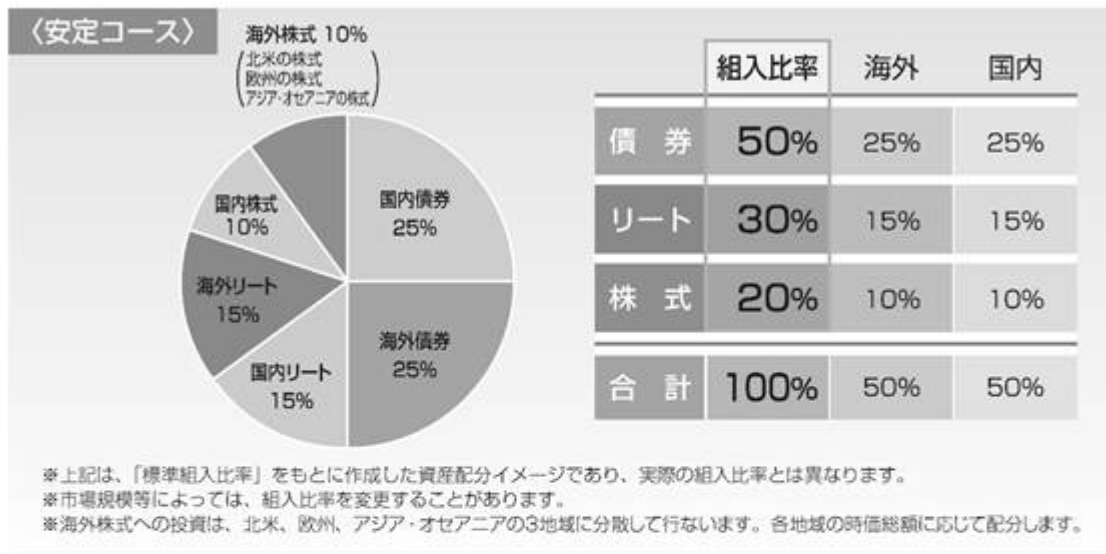
< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

# 1 内外の債券、リートおよび株式に投資します。

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



## 〈成長コース〉



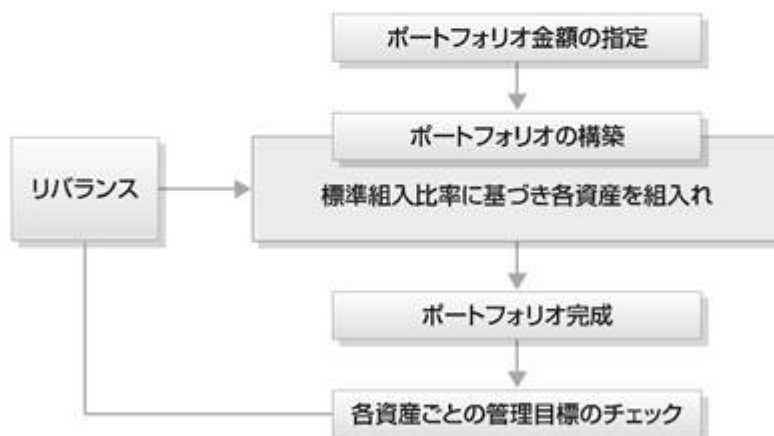
	組入比率	海外	国内
債券	10%	5%	5%
リート	40%	20%	20%
株式	50%	25%	25%
合計	100%	50%	50%

※上記は、「標準組入比率」をもとに作成した資産配分イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

※海外株式への投資は、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に分散して行ないます。各地域の時価総額に応じて配分します。

## 運用プロセス



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

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

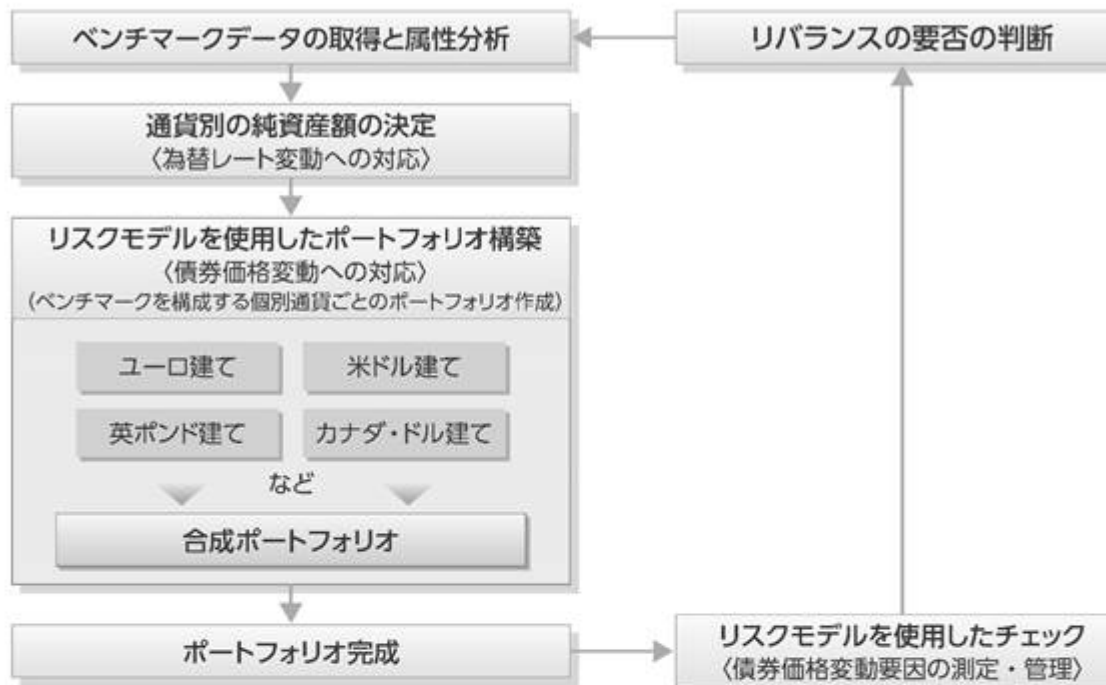
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



## 2

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

## 運用プロセス



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

## ①為替レート変動への対応

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

## ②債券価格変動への対応

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

## ③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

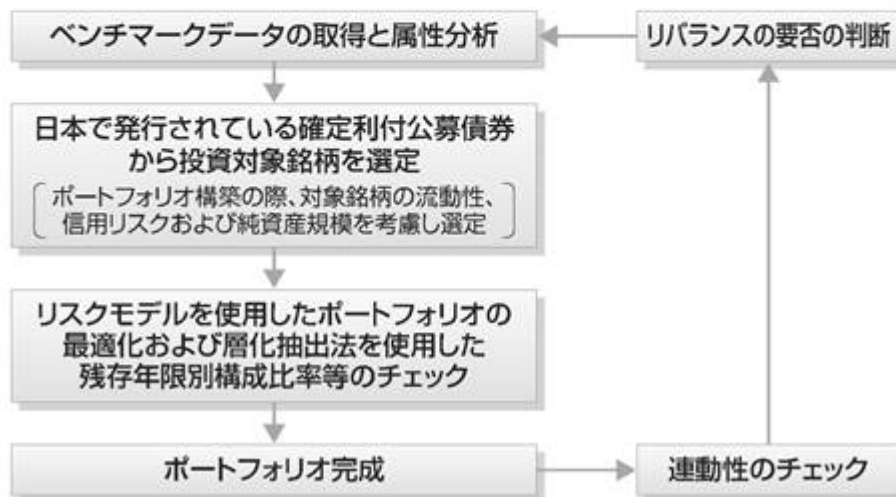
## FTSE世界国債インデックスとは

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

## 3

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

## 運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

## NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPIは、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

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

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

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

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



### 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

### 〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

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

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

### 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 5

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

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

## 投資対象のイメージ



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

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

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

※ハイブリッド優先証券とは…

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

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

## 〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

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



6

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

### 投資対象のイメージ



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

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

### 銘柄選定プロセス



定量・定性分析による銘柄選定

予想配当利回り、  
成長性、企業のファンダメンタルズ、  
株価の割安性 等

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

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

7

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

8

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

#### 〈分配方針〉

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

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### (2) 【ファンドの沿革】

2006年1月12日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注1）、償還金など お申込金（ 5）

お取扱窓口	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せん。</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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金( 5)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<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せん。</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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	2 損益 信託金( 5)	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	損益 投資	
投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないません。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します(カッコ内は投資顧問会社名)。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ北米好配当株マザーファンド(コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)</li> <li>・ダイワ欧州好配当株マザーファンド(アムンディ・アイルランド・リミテッド)</li> </ul>	

(注1) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

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

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

#### < 委託会社の概況（2021年7月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

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

#### ・ 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

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

- 1．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
- 2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

- イ. 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。
- ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率（信託財産の純資産総額に対する比率とします。）を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

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

（注）3ファンドの合計（各地域の時価総額に応じて配分します。）

- ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ニ. 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2)【投資対象】

### <各ファンド共通>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法

第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

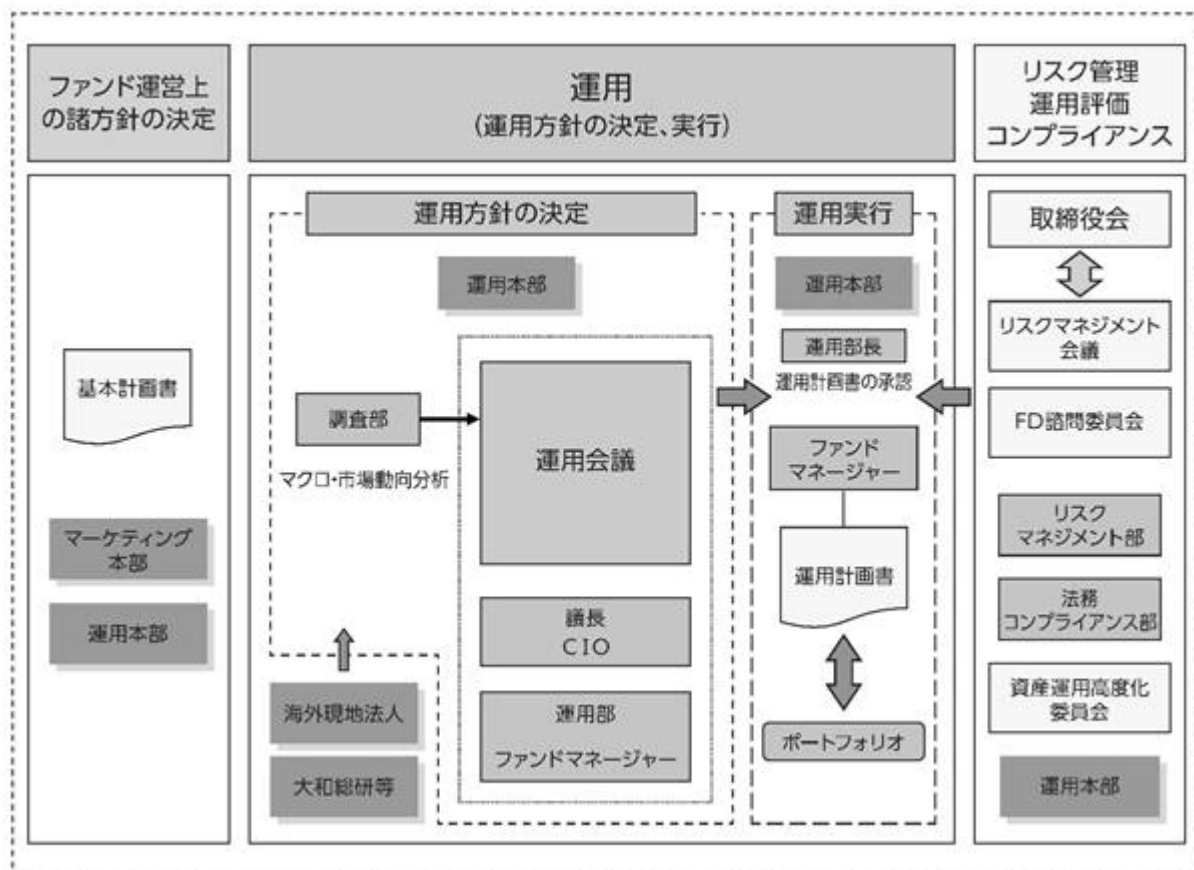
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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) 【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。

#### 八．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。

#### ニ．運用部長(各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

#### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

#### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### 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

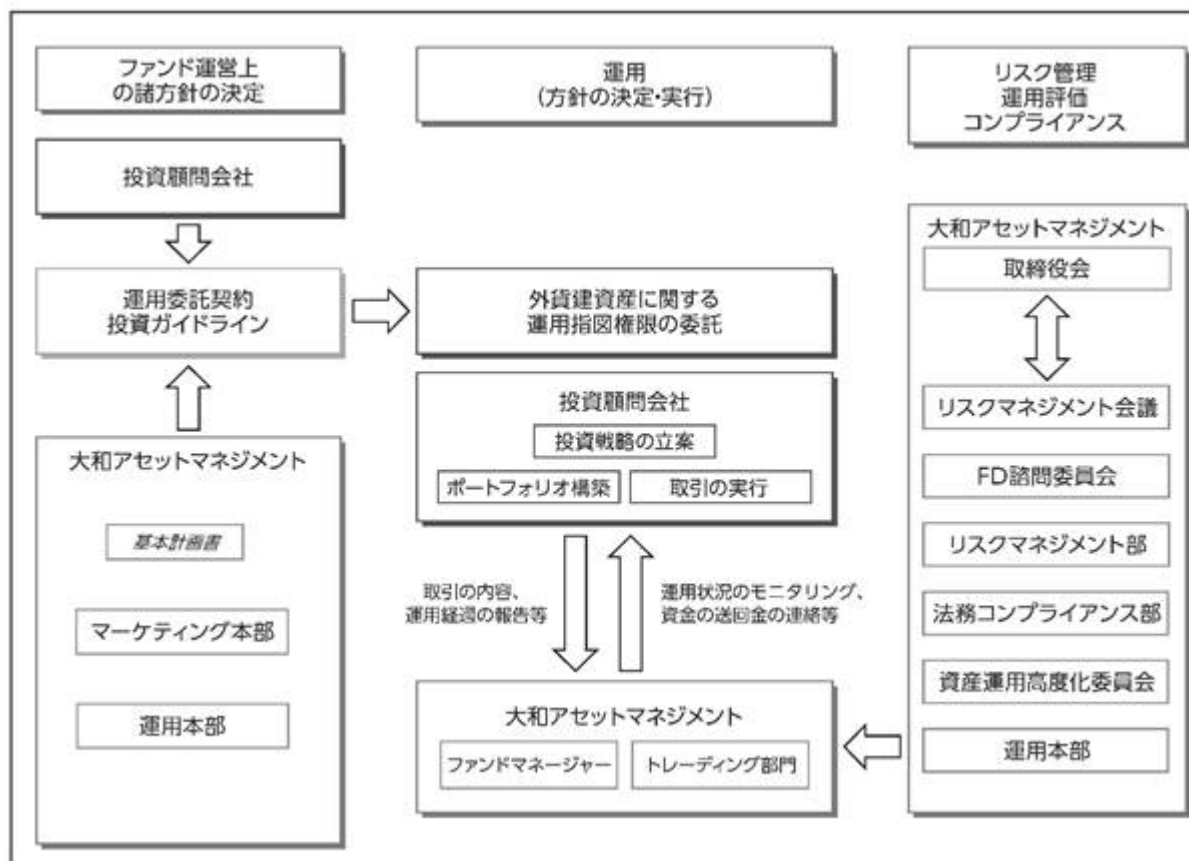
資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

#### 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。

海外(北米)株式および海外(欧州)株式部分にかかる運用体制について

（マザーファンドにかかるものを含みます。）



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

#### ロ．運用の実行

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

#### ハ．モニタリング

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

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

#### ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2021年7月30日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

<各ファンド共通>

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。



原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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>

###### 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

###### 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）

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

###### 信用リスク集中回避（信託約款）

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

###### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考> マザーファンドの概要

### 1. 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### 投資態度

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

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

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

#### (2) 投資対象

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの  
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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

#### 同一銘柄の株式

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

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 先物取引等

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。 )における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。 )、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所における

これらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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

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

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

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

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

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

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

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI 総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、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、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

#### 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### 外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。 )、有価証券指数等先物

取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

### 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (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（以下総称して  
「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## (4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

#### 4. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

#### 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．（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

5．ダイワ北米好配当株マザーファンド

6．ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7．ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## (1) 投資方針

## &lt;ダイワ北米好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

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

## &lt;ダイワ欧州好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

## &lt;ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

## (2) 投資対象

### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

12．外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券

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

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
15. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

委託会社は、信託金を、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1. ~ 11. (ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

##### 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

##### 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

##### 先物取引等

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

- 1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
- 2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
- 3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を

超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

## 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

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

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



## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、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、次の有価証券に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証券

2. ～10.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12. ～20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

## (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) 1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### (1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

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

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
  - ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。
- ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。
- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
  - ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
  - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

#### (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

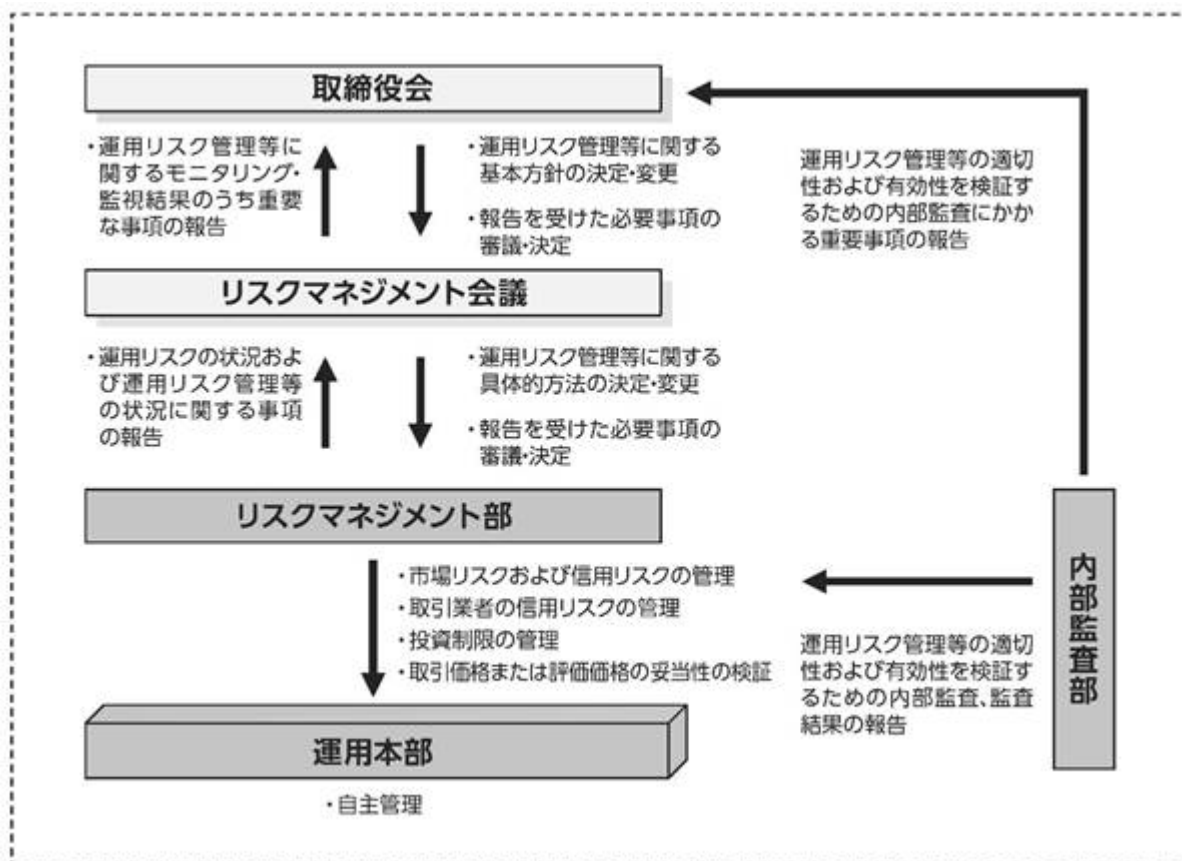
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

#### (3)その他の留意点

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

#### (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な

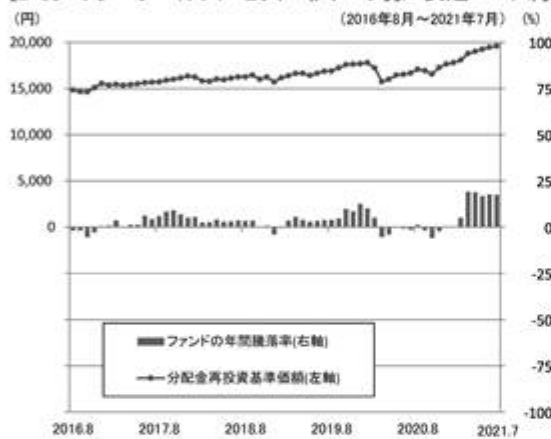
事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策(コンティンジェンシー・プラン)を定めています。

## 参考情報

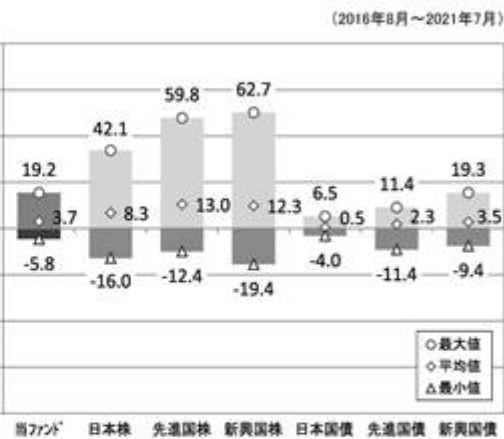
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

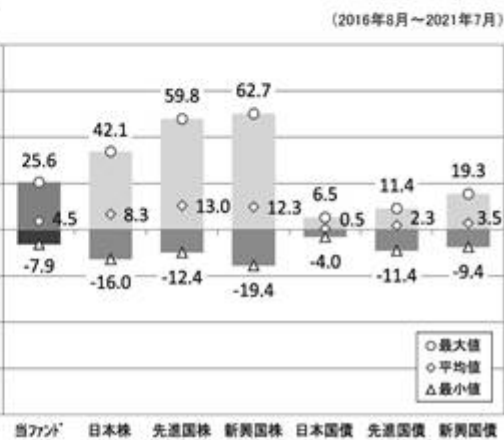
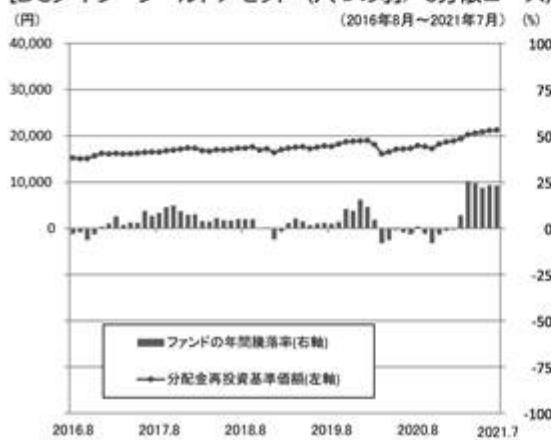
#### [DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)]



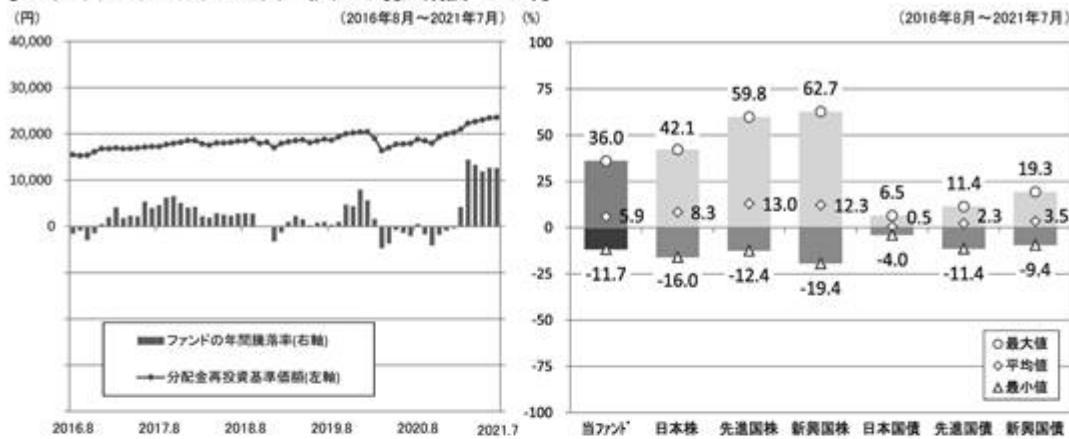
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)]



## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

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次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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、受託会社への配分については、次のとおりです。

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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。

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

#### イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

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

#### ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド



各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。

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（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

##### イ．収益分配金に対する課税

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

得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

#### <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7月30日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

## (1)【投資状況】(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)【投資資産】(2021年7月30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	ダイワ日本債券インデックスマ ザーファンド(BPI)	日本	親投資 信託受 益証券	1,330,785,337	1.2901 1,716,978,899	1.2963 1,725,097,032	24.82
2	外国債券インデックスマザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	550,465,186	3.0293 1,667,535,258	3.1273 1,721,469,776	24.77
3	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	284,230,273	2.9453 837,161,607	3.6529 1,038,264,764	14.94
4	ダイワ・グローバルREIT・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	306,949,858	2.6375 809,592,808	3.3823 1,038,196,504	14.94
5	ダイワ好配当日本株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	207,556,210	2.9793 618,385,058	3.2671 678,106,893	9.76
6	ダイワ北米好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	128,457,780	3.3992 436,657,675	4.0544 520,819,223	7.49

7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	69,439,114	1.7696 122,880,399	2.0215 140,371,168	2.02
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	8,860,515	2.7170 24,074,055	2.8716 25,443,854	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	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

## (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。

## (2) 投資資産 (2021年7月30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)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,700,000	95.68 1,120,960,468	98.78 1,157,308,752	1.125000 2031/02/15	0.51
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	98.10 1,074,107,849	94.86 1,038,654,987	0.625000 2030/08/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	99.33 1,065,884,049	96.78 1,038,504,985	0.875000 2030/11/15	0.45
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,864,000	189.46 952,505,873	178.88 899,310,327	4.500000 2041/04/25	0.39

5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	105.20 890,284,526	104.39 883,398,506	1.625000 2026/05/15	0.39
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 855,365,113	112.60 826,051,137	2.875000 2028/08/15	0.36
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 847,821,825	124.77 825,827,899	2.500000 2030/05/25	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 839,802,533	95.17 812,781,277	0.625000 2030/05/15	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 817,964,205	98.82 811,517,982	0.250000 2025/06/30	0.36
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 833,283,718	111.14 803,193,238	2.625000 2029/02/15	0.35
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	116.28 827,611,369	112.39 799,919,706	2.875000 2028/05/15	0.35
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,571,000	173.86 807,825,741	167.84 779,827,570	4.000000 2037/01/04	0.34
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.27 760,878,435	101.72 779,627,924	1.250000 2028/03/31	0.34
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	114.92 799,054,747	111.40 774,563,026	2.750000 2028/02/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	111.71 782,792,185	108.70 761,749,083	2.375000 2027/05/15	0.33
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.94 742,979,465	98.62 755,891,587	0.750000 2028/01/31	0.33
17	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	101.88 759,598,456	101.33 755,512,950	- 2023/04/14	0.33
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,920,000	119.56 765,384,825	116.52 745,918,131	1.500000 2031/05/25	0.33
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,668,000	102.86 750,981,490	101.95 744,366,972	1.625000 2022/11/15	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,086,000	110.45 730,924,320	108.47 717,788,792	2.250000 2024/05/25	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	107.84 727,592,326	106.07 715,657,284	2.375000 2024/08/15	0.31
22	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,448,000	163.79 734,815,949	159.16 714,058,335	5.500000 2031/01/04	0.31
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,101,000	108.38 719,361,520	107.22 711,649,429	1.000000 2025/11/25	0.31
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,499,000	123.39 722,293,445	120.74 706,787,129	2.750000 2027/10/25	0.31



25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	103.67 713,688,527	102.51 705,648,440	2.000000 2022/11/30	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	99.51 708,233,327	98.57 701,564,839	0.250000 2025/09/30	0.31
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,950,000	110.17 709,576,027	108.50 698,820,484	0.750000 2028/11/25	0.31
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	111.12 717,857,498	108.07 698,122,473	2.250000 2027/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	97.71 727,510,374	93.00 692,466,877	1.625000 2050/11/15	0.30
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,899,000	109.92 700,690,844	108.25 690,039,742	1.750000 2024/11/25	0.30

(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。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.68%
合計	98.68%

(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。

#### 八．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
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2021年8月	買建	126,000	11,039,868	11,067,348	0.00%
		ユーロ買/円売 2021年8 月	買建	2,288,000	299,353,523	297,699,556	0.13%
		米ドル買/円売 2021年8 月	買建	1,404,000	154,055,865	153,719,888	0.07%
		米ドル買/円売 2021年9 月	買建	1,844,000	201,924,454	201,838,892	0.09%

	英ポンド買/円売 2021年 8月	買建	144,000	21,971,289	21,996,878	0.01%
--	----------------------	----	---------	------------	------------	-------

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ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。

### (2) 投資資産 (2021年7月30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)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	137 5年国債	日本	国債証券	590,000,000	100.63 593,773,700	100.49 592,902,800	0.100000 2023/09/20	1.82
2	138 5年国債	日本	国債証券	510,000,000	100.73 513,723,700	100.57 512,922,300	0.100000 2023/12/20	1.57
3	141 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.85 433,687,800	100.75 433,246,500	0.100000 2024/09/20	1.33

4	139 5年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.77 433,325,300	100.64 432,777,800	0.100000 2024/03/20	1.33
5	135 5年国債	日本	国債証券	420,000,000	100.54 422,282,300	100.38 421,608,600	0.100000 2023/03/20	1.29
6	145 5年国債	日本	国債証券	410,000,000	101.02 414,196,210	100.99 414,087,700	0.100000 2025/09/20	1.27
7	147 5年国債	日本	国債証券	406,000,000	100.50 408,046,680	100.62 408,549,680	0.005000 2026/03/20	1.25
8	347 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	101.26 405,043,250	101.36 405,452,000	0.100000 2027/06/20	1.24
9	143 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.96 383,648,000	100.89 383,397,200	0.100000 2025/03/20	1.17
10	136 5年国債	日本	国債証券	380,000,000	100.57 382,191,300	100.43 381,645,400	0.100000 2023/06/20	1.17
11	352 10年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.17 364,234,800	101.58 365,698,800	0.100000 2028/09/20	1.12
12	360 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.66 352,316,800	101.19 354,165,000	0.100000 2030/09/20	1.09
13	419 2年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.41 351,454,200	100.32 351,120,000	0.100000 2022/12/01	1.08
14	359 10年国債	日本	国債証券	340,000,000	100.80 342,747,430	101.29 344,396,200	0.100000 2030/06/20	1.06
15	361 10年国債	日本	国債証券	330,000,000	99.98 329,948,940	101.08 333,564,000	0.100000 2030/12/20	1.02
16	334 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	102.60 328,332,800	102.14 326,851,200	0.600000 2024/06/20	1.00
17	345 10年国債	日本	国債証券	320,000,000	101.21 323,872,800	101.24 323,987,200	0.100000 2026/12/20	0.99
18	362 10年国債	日本	国債証券	315,000,000	100.24 315,768,780	100.96 318,033,450	0.100000 2031/03/20	0.97
19	348 10年国債	日本	国債証券	310,000,000	101.25 313,905,900	101.42 314,408,200	0.100000 2027/09/20	0.96
20	358 10年国債	日本	国債証券	310,000,000	100.90 312,809,700	101.38 314,302,800	0.100000 2030/03/20	0.96
21	351 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	101.27 303,820,100	101.56 304,683,000	0.100000 2028/06/20	0.93
22	337 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	101.72 305,160,400	101.51 304,539,000	0.300000 2024/12/20	0.93
23	140 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.80 302,408,800	100.69 302,082,000	0.100000 2024/06/20	0.93

24	353 10年国債	日本	国債証券	290,000,000	101.25 293,643,400	101.60 294,642,900	0.100000 2028/12/20	0.90
25	354 10年国債	日本	国債証券	280,000,000	101.12 283,142,000	101.57 284,412,800	0.100000 2029/03/20	0.87
26	350 10年国債	日本	国債証券	270,000,000	101.36 273,688,300	101.50 274,060,800	0.100000 2028/03/20	0.84
27	343 10年国債	日本	国債証券	270,000,000	101.06 272,888,660	101.13 273,051,000	0.100000 2026/06/20	0.84
28	144 5年国債	日本	国債証券	260,000,000	100.97 262,546,000	100.95 262,485,600	0.100000 2025/06/20	0.80
29	349 10年国債	日本	国債証券	250,000,000	101.38 253,460,000	101.48 253,700,000	0.100000 2027/12/20	0.78
30	13 40年国債	日本	国債証券	252,000,000	93.46 235,537,990	93.06 234,533,880	0.500000 2060/03/20	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	88.38%
地方債証券	5.44%
特殊債券	2.24%
社債券	3.15%
合計	99.21%

(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。

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。

## (2) 投資資産（2021年7月30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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,091,215	1,347.77 2,818,538,410	1,819.35 3,804,652,010	4.23

2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	91,119	26,729.79 2,435,600,333	34,140.07 3,110,809,667	3.46
3	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,230,886	950.34 2,120,217,070	1,284.05 2,864,584,338	3.19
4	LINK REIT	香港	投資証券	2,707,792	1,014.38 2,746,742,487	1,056.75 2,861,459,196	3.18
5	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	497,730	4,478.79 2,229,255,988	5,574.13 2,774,414,662	3.09
6	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	31,973	75,044.00 2,399,383,233	86,100.74 2,752,899,158	3.06
7	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,912,627	194.46 2,122,949,686	227.21 2,479,530,004	2.76
8	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	173,053	12,970.84 2,244,646,045	13,786.98 2,385,878,388	2.65
9	UDR INC	アメリカ	投資証券	389,597	4,959.67 1,932,278,029	6,086.54 2,371,301,270	2.64
10	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	554,779	3,488.24 1,935,216,081	4,066.45 2,255,985,836	2.51
11	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,721,005	783.04 2,131,088,861	787.32 2,142,315,370	2.38
12	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	399,252	4,445.07 1,774,730,325	5,352.96 2,137,182,421	2.38
13	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	216,405	8,470.25 1,833,006,698	9,605.55 2,078,690,714	2.31
14	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	11,948,832	170.79 2,041,338,289	173.06 2,067,886,374	2.30
15	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	144,756	11,149.47 1,613,964,664	14,002.67 2,026,971,382	2.25
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	50,689	31,934.83 1,618,749,394	36,197.39 1,834,809,704	2.04
17	KLEPIERRE	フランス	投資証券	662,656	2,763.79 1,831,464,250	2,712.79 1,797,648,890	2.00
18	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,609,677	333.10 1,535,756,449	383.32 1,766,998,904	1.97
19	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	266,915	6,198.22 1,654,419,996	6,529.98 1,742,950,573	1.94
20	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	80,799	16,281.49 1,315,530,358	21,419.52 1,730,676,499	1.93
21	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	827,144	1,960.85 1,621,976,215	1,972.88 1,631,861,148	1.82

22	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	856,450	1,401.72 1,200,508,039	1,825.48 1,563,434,059	1.74
23	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	198,334	7,213.20 1,430,623,047	7,853.71 1,557,659,246	1.73
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	870,208	1,882.24 1,637,956,367	1,782.49 1,551,143,323	1.73
25	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	54,950	23,549.54 1,294,051,439	25,173.94 1,383,308,047	1.54
26	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	393,969	3,131.30 1,233,678,856	3,393.09 1,336,774,283	1.49
27	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	67,133	14,420.92 968,120,153	19,022.79 1,277,057,136	1.42
28	AEDIFICA	ベルギー	投資証券	80,264	12,852.00 1,031,559,264	15,639.22 1,255,266,515	1.40
29	KEPPEL REIT	シンガポール	投資証券	12,861,600	95.10 1,224,149,071	96.23 1,237,739,934	1.38
30	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	投資証券	120,017	9,602.24 1,152,438,214	9,488.92 1,138,831,988	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	94.10%
合計	94.10%

(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
為替予約取引	日本	シンガポール・ドル買/ 円売 2021年8月	買建	31,263	2,529,908	2,528,164	0.00%

ユーロ買/円売 2021年8月	買建	48,609	6,327,502	6,324,598	0.01%
米ドル買/円売 2021年8月	買建	5,400,000	591,233,742	591,230,340	0.66%
米ドル売/円買 2021年8月	売建	80,897	8,857,410	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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資状況 (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。

### (2) 投資資産 (2021年7月30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	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	14,758	678,139.59 10,007,984,166	687,000.00 10,138,746,000	8.21
2	日本ビルファンド	日本	投資証券	11,386	700,934.89 7,980,844,756	708,000.00 8,061,288,000	6.53
3	GLP投資法人	日本	投資証券	35,675	181,090.58 6,460,406,721	196,500.00 7,010,137,500	5.68
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	39,855	172,571.14 6,877,823,001	174,100.00 6,938,755,500	5.62
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	17,196	347,635.54 5,977,940,774	366,000.00 6,293,736,000	5.10
6	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	17,846	302,805.84 5,403,873,131	326,000.00 5,817,796,000	4.71
7	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	50,810	111,203.41 5,650,245,675	114,500.00 5,817,745,000	4.71
8	日本アコモデーションファンド 投資法人	日本	投資証券	6,364	642,803.07 4,090,798,774	671,000.00 4,270,244,000	3.46
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	11,297	353,015.31 3,988,014,033	373,500.00 4,219,429,500	3.42
10	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	19,551	176,047.36 3,441,901,956	201,000.00 3,929,751,000	3.18
11	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	7,645	462,674.22 3,537,144,416	505,000.00 3,860,725,000	3.13
12	森ヒルズリート	日本	投資証券	23,276	157,630.45 3,669,006,424	161,100.00 3,749,763,600	3.04
13	オリックス不動産投資	日本	投資証券	17,374	191,575.57 3,328,434,050	209,000.00 3,631,166,000	2.94
14	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	20,903	163,545.42 3,418,589,956	161,100.00 3,367,473,300	2.73
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	30,224	90,027.05 2,720,977,647	96,600.00 2,919,638,400	2.37
16	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	日本	投資証券	10,870	221,300.00 2,405,531,000	237,300.00 2,579,451,000	2.09
17	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,181	561,261.46 2,346,634,176	614,000.00 2,567,134,000	2.08
18	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,766	432,935.66 2,496,307,042	428,000.00 2,467,848,000	2.00
19	API投資法人	日本	投資証券	4,634	498,197.86 2,308,648,926	497,500.00 2,305,415,000	1.87
20	産業ファンド	日本	投資証券	10,339	198,496.24 2,052,252,716	211,900.00 2,190,834,100	1.78

21	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	7,058	276,094.71 1,948,676,509	304,000.00 2,145,632,000	1.74
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,620	498,833.23 1,805,776,303	508,000.00 1,838,960,000	1.49
23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	9,482	172,738.21 1,637,903,809	193,800.00 1,837,611,600	1.49
24	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	2,162	792,360.37 1,713,083,122	807,000.00 1,744,734,000	1.41
25	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	39,768	42,648.56 1,696,048,006	43,050.00 1,712,012,400	1.39
26	イオンリート投資	日本	投資証券	10,311	150,414.15 1,550,920,366	159,500.00 1,644,604,500	1.33
27	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,080	778,000.00 1,618,240,000	790,000.00 1,643,200,000	1.33
28	日本リート投資法人	日本	投資証券	3,601	427,655.96 1,539,989,157	454,000.00 1,634,854,000	1.32
29	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	19,784	65,315.81 1,292,208,094	66,700.00 1,319,592,800	1.07
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	3,711	350,563.84 1,300,942,424	350,500.00 1,300,705,500	1.05

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.92%
合計	96.92%

(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	日本	TREIT先物 030 9月	買建	1,200	2,512,092,000	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) 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。

### (2) 投資資産 (2021年7月30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	業種	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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	12,649	14,447.09 182,742,066	15,946.12 201,702,517	5.29
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,555	27,984.54 155,454,170	31,368.88 174,254,156	4.57

3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	298	364,930.17 108,749,191	394,155.24 117,458,262	3.08
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	2,882	33,155.76 95,554,906	39,232.45 113,067,940	2.96
5	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	アメリカ	株式	情報技術	1,642	54,816.16 90,008,149	60,011.46 98,538,832	2.58
6	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,438	24,304.59 83,559,181	27,144.76 93,323,688	2.45
7	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	10,587	8,423.94 89,185,069	8,557.73 90,600,776	2.38
8	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,292	55,908.87 72,234,271	68,069.93 87,946,353	2.31
9	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	2,010	41,422.25 83,258,736	42,570.80 85,567,322	2.24
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,773	16,555.98 79,021,706	16,751.97 79,957,153	2.10
11	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	12,153	6,317.57 76,777,465	6,129.25 74,488,778	1.95
12	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	8,018	9,927.45 79,598,361	8,439.48 67,667,824	1.77
13	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,228	52,259.57 64,174,761	53,005.20 65,090,390	1.71
14	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,977	17,509.64 52,126,201	18,851.98 56,122,369	1.47
15	RENEWABLE ENERGY GROUP INC	アメリカ	株式	エネルギー	8,030	6,911.44 55,499,896	6,744.58 54,159,010	1.42
16	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,275	19,293.23 43,892,105	21,001.27 47,777,905	1.25
17	ESSENTIAL UTILITIES INC	アメリカ	株式	公益事業	8,385	5,282.67 44,296,044	5,436.17 45,582,357	1.19
18	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,178	13,565.81 43,112,147	14,308.15 45,471,311	1.19

19	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,434	12,940.62 44,438,100	13,228.58 45,426,950	1.19
20	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	760	52,340.59 39,778,856	58,442.47 44,416,283	1.16
21	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本 財・サー ビス	2,544	15,354.87 39,062,809	17,267.66 43,928,947	1.15
22	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	9,927	4,366.46 43,345,860	4,235.07 42,041,572	1.10
23	NORFOLK SOUTHERN CORP	アメリカ	株式	資本 財・サー ビス	1,443	29,763.76 42,949,108	28,033.81 40,452,802	1.06
24	TYSON FOODS INC-CL A	アメリカ	株式	生活必 需品	5,086	8,568.68 43,580,344	7,874.52 40,049,813	1.05
25	DANAHER CORP	アメリカ	株式	ヘルス ケア	1,220	25,981.97 31,698,012	32,587.50 39,756,761	1.04
26	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	3,767	8,845.69 33,321,741	10,541.69 39,710,573	1.04
27	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーション・サー ビス	131	245,466.72 32,156,141	297,325.56 38,949,650	1.02
28	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本 財・サー ビス	2,425	14,924.91 36,193,077	16,008.53 38,820,692	1.02
29	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	8,164	4,069.74 33,225,384	4,685.07 38,248,969	1.00
30	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	920	36,717.47 33,780,074	41,337.94 38,030,914	1.00

(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
株式	77.37%
ハイブリッド優先証券	16.61%
投資証券	0.51%
合計	94.49%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.82%
素材	1.79%
資本財・サービス	7.70%
一般消費財・サービス	7.33%
生活必需品	3.59%
ヘルスケア	9.00%
金融	7.80%
情報技術	25.50%
コミュニケーション・サービス	8.27%
公益事業	3.57%
合計	77.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### 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。

(2) 投資資産（2021年7月30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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,578	12,969.62 72,344,552	13,740.64 76,645,318	5.35
2	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	37,336.60 49,022,966	42,007.46 55,155,795	3.85
3	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,895	17,281.21 50,029,104	18,059.26 52,281,581	3.65
4	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,823	6,259.59 42,709,197	7,590.61 51,790,783	3.62
5	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	95	464,668.25 44,143,484	541,770.55 51,468,202	3.59
6	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	1,107.10 53,310,474	1,042.83 50,215,472	3.51
7	DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	21,145	2,090.86 44,211,398	2,300.86 48,651,795	3.40
8	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	18,054.06 50,551,378	17,328.04 48,518,539	3.39
9	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	2,117	19,308.32 40,875,722	21,969.07 46,508,529	3.25
10	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,883	19,646.61 36,994,567	23,627.97 44,491,479	3.11
11	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	9,653.49 42,369,203	10,093.39 44,299,897	3.09
12	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,893	10,929.24 42,547,531	11,257.11 43,823,957	3.06

13	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	903	45,826.32 41,381,167	44,400.29 40,093,462	2.80
14	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルス ケア	7,785	6,486.63 50,498,445	5,023.54 39,108,314	2.73
15	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消 費財・ サービ ス	2,155	15,997.02 34,473,588	17,916.14 38,609,297	2.70
16	AXA SA	フランス	株式	金融	12,126	3,071.89 37,249,824	2,851.36 34,575,599	2.41
17	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルス ケア	15,900	1,969.99 31,322,888	2,148.41 34,159,825	2.38
18	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消 費財・ サービ ス	2,996	11,346.89 33,995,292	11,068.45 33,161,099	2.31
19	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	9,232.60 33,939,058	8,686.14 31,930,264	2.23
20	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	87,929	369.25 32,467,975	360.53 31,701,464	2.21
21	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必 需品	88,445	347.37 30,723,692	356.31 31,514,076	2.20
22	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	28,266.39 32,365,025	27,518.26 31,508,413	2.20
23	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,382.29 35,362,745	2,099.68 31,167,742	2.18
24	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,037	34,062.79 35,323,122	29,899.27 31,005,551	2.16
25	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネル ギー	6,299	4,982.56 31,385,160	4,879.77 30,737,706	2.15
26	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	100,555	296.78 29,842,804	305.36 30,706,296	2.14
27	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必 需品	4,489	6,292.18 28,245,616	6,273.85 28,163,327	1.97
28	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	6,763.11 26,984,840	6,774.82 27,031,563	1.89
29	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	655.18 28,437,763	612.56 26,587,884	1.86



30	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	2,197.29 25,842,443	2,228.15 26,205,358	1.83
----	--------------------------------	------	----	-------	--------	------------------------	------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.32%
合計	94.32%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.15%
素材	9.07%
資本財・サービス	10.65%
一般消費財・サービス	5.52%
生活必需品	11.06%
ヘルスケア	15.12%
金融	21.01%
情報技術	3.11%
コミュニケーション・サービス	6.87%
公益事業	6.77%
合計	94.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### 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。

## (2) 投資資産 (2021年7月30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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	26,000	2,400.26 62,406,864	2,286.52 59,449,676	8.49
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	6,900	8,038.80 55,467,720	7,560.30 52,166,070	7.45
3	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	8,800	3,720.36 32,739,244	4,312.26 37,947,921	5.42
4	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	4,150	7,361.00 30,548,287	8,041.52 33,372,337	4.77
5	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,700	4,452.96 20,928,913	4,967.22 23,345,980	3.34
6	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	17,600	1,393.50 24,525,618	1,296.98 22,826,927	3.26
7	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	6,000	3,721.97 22,331,868	3,659.22 21,955,356	3.14
8	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	3,100	6,501.12 20,153,491	7,045.00 21,839,500	3.12
9	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	2,000	13,110.90 26,221,800	10,909.80 21,819,600	3.12

10	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	10,400	2,160.57 22,470,024	2,083.76 21,671,127	3.10
11	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	9,600	2,048.18 19,662,564	1,982.68 19,033,797	2.72
12	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	87,000	206.68 17,981,978	214.14 18,630,284	2.66
13	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	3,500	5,091.24 17,819,340	5,033.82 17,618,370	2.52
14	NAVER CORP	韓国	株式	コミュニケーション・サービス	390	37,466.55 14,611,955	42,060.15 16,403,459	2.34
15	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	3,400	3,938.05 13,389,387	4,277.79 14,544,486	2.08
16	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,800	2,320.16 13,456,930	2,466.53 14,305,903	2.04
17	MERIDA INDUSTRY CO LTD	台湾	株式	一般消費財・サービス	11,000	1,384.46 15,229,126	1,282.49 14,107,434	2.02
18	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,000	12,558.36 12,558,367	12,705.53 12,705,532	1.82
19	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	141,000	86.67 12,221,344	89.42 12,608,446	1.80
20	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	500	21,654.30 10,827,154	23,531.87 11,765,939	1.68
21	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	13,500	969.03 13,082,057	861.60 11,631,647	1.66
22	POSCO	韓国	株式	素材	330	32,394.45 10,690,169	34,356.30 11,337,579	1.62
23	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	85,000	125.11 10,634,503	129.81 11,034,547	1.58
24	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	143,000	92.71 13,257,845	76.22 10,900,447	1.56
25	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費財・サービス	500	22,250.25 11,125,125	21,245.40 10,622,700	1.52

26	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	香港	株式	資本 財・サー ビス	5,500	1,966.96 10,818,302	1,914.83 10,531,571	1.50
27	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	23,000	476.52 10,960,029	435.34 10,012,866	1.43
28	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	6,000	1,707.15 10,242,991	1,587.94 9,527,658	1.36
29	FORTESCUE METALS GROUP LTD	オースト ラリア	株式	素材	4,200	1,636.60 6,873,747	2,126.61 8,931,796	1.28
30	LG ELECTRONICS INC	韓国	株式	一般消 費財・サ ービス	500	15,455.55 7,727,775	15,934.05 7,967,025	1.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.38%
合計	95.38%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	0.43%
素材	12.20%
資本財・サービス	1.50%
一般消費財・サービス	11.60%
生活必需品	2.57%
ヘルスケア	1.68%
金融	32.02%
情報技術	28.81%
コミュニケーション・サービス	3.20%
不動産	1.36%
合計	95.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

## 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。

## (2) 投資資産（2021年7月30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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 日立	日本	株式	電気機器	88,500	5,121.00 453,208,500	6,258.00 553,833,000	3.55
2 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	51,200	8,564.00 438,476,800	9,805.00 502,016,000	3.22
3 武田薬品	日本	株式	医薬品	107,900	3,715.00 400,848,500	3,682.00 397,287,800	2.55
4 KDDI	日本	株式	情報・通信業	113,600	3,448.00 391,692,800	3,332.00 378,515,200	2.43
5 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	652,100	591.60 385,782,360	578.50 377,239,850	2.42
6 三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	101,900	3,910.00 398,429,000	3,695.00 376,520,500	2.41
7 東京海上HD	日本	株式	保険業	68,300	5,366.00 366,497,800	5,210.00 355,843,000	2.28

8	AGC	日本	株式	ガラス・ 土石製 品	72,600	4,905.00 356,103,000	4,665.00 338,679,000	2.17
9	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	43,200	6,956.00 300,499,200	7,831.00 338,299,200	2.17
10	デクセリアルズ	日本	株式	化学	131,000	1,969.00 257,939,000	2,515.00 329,465,000	2.11
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	6,700	48,940.00 327,898,000	44,920.00 300,964,000	1.93
12	富士電機	日本	株式	電気機 器	58,000	4,930.00 285,940,000	4,760.00 276,080,000	1.77
13	アドバンテスト	日本	株式	電気機 器	28,000	10,490.00 293,720,000	9,610.00 269,080,000	1.73
14	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用 機器	178,600	1,463.11 261,313,110	1,450.00 258,970,000	1.66
15	オリックス	日本	株式	その他 金融業	132,400	1,822.50 241,299,000	1,912.00 253,148,800	1.62
16	旭化成	日本	株式	化学	200,500	1,231.00 246,815,500	1,187.00 237,993,500	1.53
17	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	81,600	2,856.00 233,049,600	2,802.50 228,684,000	1.47
18	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	99,800	1,757.83 175,431,486	2,204.00 219,959,200	1.41
19	プレミアグループ	日本	株式	その他 金融業	62,400	2,534.00 158,121,600	3,345.00 208,728,000	1.34
20	三井物産	日本	株式	卸売業	77,700	2,300.00 178,710,000	2,499.50 194,211,150	1.25
21	大日本印刷	日本	株式	その他 製品	74,300	2,307.89 171,476,304	2,566.00 190,653,800	1.22
22	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	24,900	7,242.00 180,325,800	7,482.00 186,301,800	1.19
23	MS & AD	日本	株式	保険業	54,000	3,180.00 171,720,000	3,380.00 182,520,000	1.17
24	IHI	日本	株式	機械	70,800	2,218.00 157,034,400	2,516.00 178,132,800	1.14
25	三洋貿易	日本	株式	卸売業	146,400	1,124.00 164,553,600	1,203.00 176,119,200	1.13
26	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	191,000	941.00 179,731,000	896.00 171,136,000	1.10

27	リコー	日本	株式	電気機器	139,900	1,189.00 166,341,100	1,191.00 166,620,900	1.07
28	日本ユニシス	日本	株式	情報・通信業	50,600	3,471.50 175,658,294	3,290.00 166,474,000	1.07
29	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	81,600	2,014.00 164,342,400	2,012.00 164,179,200	1.05
30	信越化学	日本	株式	化学	9,100	18,885.00 171,853,500	17,750.00 161,525,000	1.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.91%
合計	98.91%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	0.37%
建設業	3.07%
食料品	1.85%
繊維製品	2.05%
化学	13.07%
医薬品	2.55%
ゴム製品	0.66%
ガラス・土石製品	3.10%
鉄鋼	0.59%
非鉄金属	2.11%
金属製品	2.14%
機械	4.78%
電気機器	12.72%
輸送用機器	7.02%
精密機器	0.59%
その他製品	2.85%
陸運業	1.69%
倉庫・運輸関連業	0.92%
情報・通信業	7.28%
卸売業	9.10%
小売業	2.57%

銀行業	5.85%
証券、商品先物取引業	0.62%
保険業	4.51%
その他金融業	2.96%
不動産業	1.18%
サービス業	2.70%
合計	98.91%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 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。

#### (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か月間	0.6%
3か月間	3.0%
6か月間	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	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、収益配分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

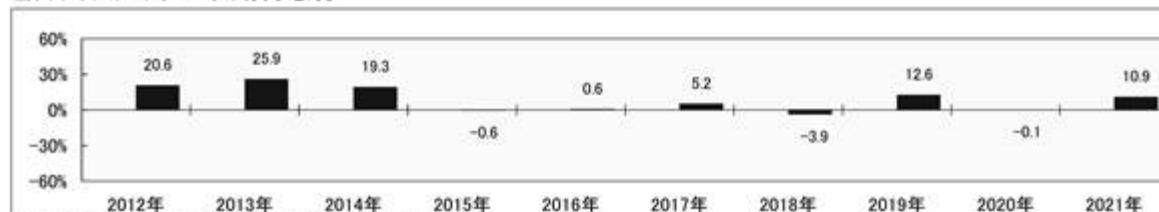
※比率は、純資産総額に対するものです。

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%
			その他	1.1%	BB以下・無格付	1.6%	日本プロロジスリート	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.4%							
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) 【投資資産】(2021年7月30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	ダイワ・REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	358,071,886	2.9532 1,057,466,126	3.6529 1,308,000,792	16.63
2	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	1,005,661,455	1.2902 1,297,514,861	1.2963 1,303,638,944	16.58
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	385,216,274	2.6380 1,016,222,556	3.3823 1,302,917,003	16.57
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	415,805,046	3.0302 1,259,997,602	3.1273 1,300,347,120	16.54
5	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	392,170,010	2.9887 1,172,113,640	3.2671 1,281,258,639	16.29
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	242,520,141	3.4087 826,698,571	4.0544 983,273,659	12.50
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	131,208,410	1.7719 232,498,378	2.0215 265,237,800	3.37

8	ダイワ・アジア・オセアニア好 配当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	16,759,031	2.7229 45,634,759	2.8716 48,125,233	0.61
---	------------------------------	----	-------------------	------------	----------------------	----------------------	------

(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。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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。

#### 八．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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	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

(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。

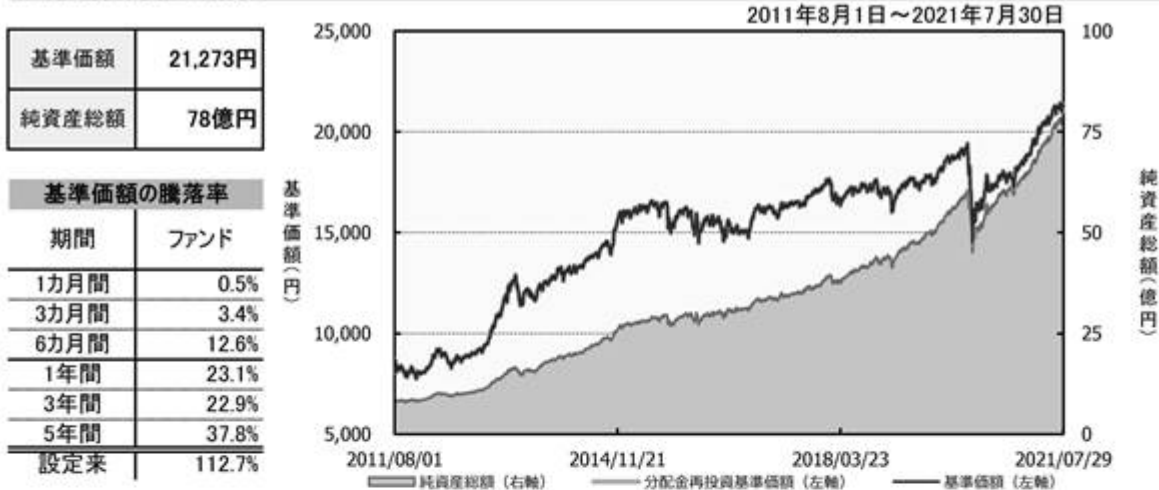
（参考情報）運用実績

## ●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



※上記の「基準価額の騰落率」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、収益配分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。

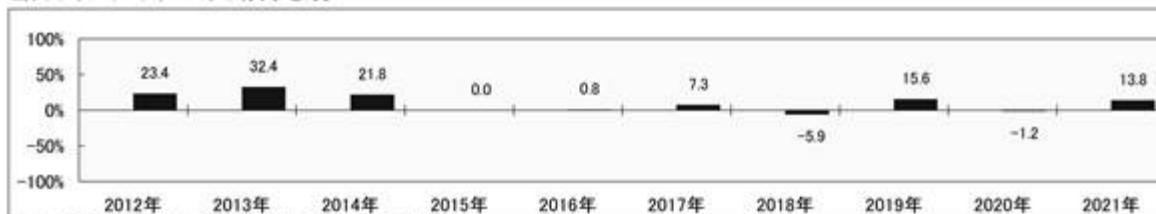
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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) 【投資資産】(2021年7月30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 ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	704,604,924	3.0017 2,115,050,103	3.2671 2,302,014,747	24.50
2 ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	514,877,066	2.9831 1,535,934,786	3.6529 1,880,794,434	20.02
3 ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	551,115,029	2.6594 1,465,659,312	3.3823 1,864,036,362	19.84
4 ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	435,567,619	3.4322 1,494,998,239	4.0544 1,765,965,354	18.80
5 ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	235,843,926	1.7815 420,172,264	2.0215 476,758,496	5.07
6 ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	361,418,522	1.2899 466,223,448	1.2963 468,506,830	4.99
7 外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	149,366,659	3.0334 453,101,226	3.1273 467,114,352	4.97



8	ダイワ・アジア・オセアニア好配 当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	30,150,186	2.7348 82,457,638	2.8716 86,579,274	0.92
---	------------------------------	----	-------------------	------------	----------------------	----------------------	------

(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。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.11%
合計	99.11%

(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。

#### 八．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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	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

(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



※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。

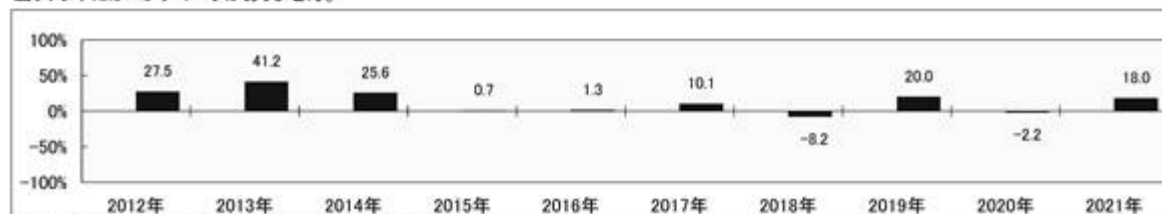
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

#### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受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付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

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

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

・公社債等：原則として次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）  
ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

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



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

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 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)を毎計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 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。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2020年1月11日から2021年1月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	74,937,153	81,799,886
親投資信託受益証券	4,881,516,489	5,787,677,732
未収入金	1,627,000	5,331,000
流動資産合計	4,958,080,642	5,874,808,618
資産合計	4,958,080,642	5,874,808,618
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,772,291	8,379,643
未払受託者報酬	1,259,547	1,524,940
未払委託者報酬	21,413,042	25,924,802
その他未払費用	190,310	228,659
流動負債合計	32,635,190	36,058,044
負債合計	32,635,190	36,058,044
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,794,039,123	1 3,298,446,758
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,131,406,329	2,540,303,816
（分配準備積立金）	809,610,553	794,784,674
元本等合計	4,925,445,452	5,838,750,574
純資産合計	4,925,445,452	5,838,750,574
負債純資産合計	4,958,080,642	5,874,808,618

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期		第15期	
	自	2019年1月11日 至 2020年1月10日	自	2020年1月11日 至 2021年1月12日
営業収益				
受取利息		86		268
有価証券売買等損益		515,590,216		116,700,243
その他収益		12,290		-
営業収益合計		515,602,592		116,700,511
営業費用				
支払利息		28,796		22,969
受託者報酬		2,310,362		2,832,399
委託者報酬	1	39,277,784	1	48,152,274
その他費用		348,477		425,241
営業費用合計		41,965,419		51,432,883
営業利益		473,637,173		65,267,628
経常利益		473,637,173		65,267,628
当期純利益		473,637,173		65,267,628
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		30,783,675		34,314,381
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,308,066,757		2,131,406,329
剰余金増加額又は欠損金減少額		558,472,976		653,758,242
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		558,472,976		653,758,242
剰余金減少額又は欠損金増加額		177,986,902		344,442,764
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		177,986,902		344,442,764
分配金		2 -		2 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,131,406,329		2,540,303,816

## (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15期	
	自 2020年1月11日	至 2021年1月12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  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年1月12日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首元本額	2,288,972,489円	2,794,039,123円
期中追加設定元本額	809,239,523円	963,521,848円
期中一部解約元本額	304,172,889円	459,114,213円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,794,039,123口	3,298,446,758口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 2019年1月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	5,187,830円	6,401,998円

2. 2 分配金の計算過程	<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(319,449,859円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,469,707,616円)及び分配準備積立金(490,160,694円)より分配可能額は2,279,318,169円(1万口当たり8,157.79円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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(99,590,309円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,995,605,114円)及び分配準備積立金(695,194,365円)より分配可能額は2,790,389,788円(1万口当たり8,459.71円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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	<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、金利変動等)、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	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	第15期 2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12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	498,085,750	129,952,953
合計	498,085,750	129,952,953

## （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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7628円 (17,628円)	1.7702円 (17,702円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	471,628,775	1,425,639,461	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,101,820,763	1,421,899,694	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	325,929,946	859,412,081	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	203,970,079	604,485,726	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	132,401,213	448,919,552	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	70,482,573	123,922,459	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	9,134,583	24,717,268	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	299,003,468	878,681,491	
親投資信託受益証券 合計			5,787,677,732	
合計			5,787,677,732	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	979,808,502	808,209,810
コール・ローン	1,651,905,787	1,190,976,152
国債証券	189,735,396,998	210,809,825,116
派生商品評価勘定	8,389,024	3,923,781
未収利息	1,364,622,870	1,316,013,992
前払費用	49,815,516	39,582,701
流動資産合計	193,789,938,697	214,168,531,552
資産合計	193,789,938,697	214,168,531,552
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	716,267	2,029,163
未払金	715,810,978	398,271
未払解約金	49,890,878	64,770,905
流動負債合計	766,418,123	67,198,339
負債合計	766,418,123	67,198,339
純資産の部		
元本等		
元本	1 67,069,648,143	70,827,785,140
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金( )	125,953,872,431	143,273,548,073
元本等合計	193,023,520,574	214,101,333,213
純資産合計	193,023,520,574	214,101,333,213
負債純資産合計	193,789,938,697	214,168,531,552

## 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1月11日 至 2021年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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)、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>
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相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	61,542,450,975円	67,069,648,143円
期中追加設定元本額	9,548,012,549円	13,637,218,460円
期中一部解約元本額	4,020,815,381円	9,879,081,463円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	650,299,726円	602,461,239円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,093,366円	12,073,691円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	124,735,116円	102,820,108円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	42,191,319円	29,649,083円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	428,004,948円	335,728,560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)	38,583,061円	101,745,014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)	451,731,396円	470,402,250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)	1,546,708,676円	1,857,026,512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)	795,050,364円	676,573,763円
D - I ' s 外国債券インデッ クス	2,503,662円	948,935円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	505,722円	1,138,009円
i F r e e 外国債券イン デックス	614,937,192円	988,266,664円
i F r e e 8資産バランス	816,870,082円	1,032,007,540円
i F r e e 年金バランス	15,278,264円	73,460,835円
DCダイワ外国債券インデッ クス	45,822,888,977円	48,824,975,540円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	791,449,867円	832,230,744円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	416,869,610円	473,441,226円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	261,532,079円	291,976,212円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	423,869,091円	471,628,775円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	331,858,792円	348,917,972円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	108,639,633円	116,184,508円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	9,489,359円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	20,637,601円	20,967,274円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,581,906円	5,169,837円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	77,238,656円	177,823,083円
ダイワつみたてインデックス バランス30	735,776円	3,152,607円
ダイワつみたてインデックス バランス50	61,308円	1,016,919円

ダイワつみたてインデックス バランス70	217,968円	1,041,435円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	199,765,495円	176,190,863円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	152,054,653円	136,140,957円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,894,427,212円	4,233,822,499円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	280,209,141円	248,882,370円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,395,781円	142,743,446円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	33,400,825円	32,452,799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)	1,683,601,854円	2,015,730,533円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,748,578,972円	5,878,588,200円
ダイワライフスタイル25	34,955,853円	33,238,853円
ダイワライフスタイル50	62,515,800円	60,572,925円
ダイワライフスタイル75	17,179,040円	16,593,360円
計	67,069,648,143円	70,827,785,140円
2. 期末日における受益権の総数	67,069,648,143口	70,827,785,140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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 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1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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,460,304,757	2,281,627,082
合計	1,460,304,757	2,281,627,082

(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1月10日まで、及び2020年12月1日から2021年1月12日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2021年1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	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618
アメリカ・ドル	608,468,766	-	611,164,260	2,695,494	475,790,631	-	479,528,400	3,737,769
イギリス・ポ ンド	43,636,685	-	43,645,500	8,815	21,131,788	-	21,277,410	145,622
オーストラ リア・ドル	6,864,138	-	6,759,000	105,138	-	-	-	-
カナダ・ドル	23,443,239	-	23,533,750	90,511	-	-	-	-
ノルウェー ・クローネ	42,314,983	-	42,168,600	146,383	-	-	-	-
ポーランド ・ズロチ	28,244,515	-	28,238,070	6,445	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	51,349,185	-	51,586,500	237,315	-	-	-	-
ユーロ	700,991,421	-	706,346,800	5,355,379	618,374,023	-	616,385,250	1,988,773
南アフリカ ・ランド	41,054,791	-	40,598,000	456,791	-	-	-	-
合計	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757	1,115,296,442	-	1,117,191,060	1,894,618

## (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1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8780円 (28,780円)	3.0228円 (30,228円)

附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2% United States Treasury Note/Bond 20220215	アメリカ・ドル 3,224,000.000	アメリカ・ドル 3,290,607.840	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,512,286.530	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,603,574.260	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,849,502.960	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,517,518.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,856,283.600	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,841,714.560	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,385,022.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,637,071.160	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,278,091.360	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	757,233.900	

6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,091,322.000	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	962,963.800	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	938,161.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	981,591.660	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	632,486.140	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,047,566.520	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,375,039.960	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,679,198.640	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,289,752.310	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	790,057.080	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	759,924.990	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,377,871.990	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,610,641.590	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,569,870.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,770,096.900	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,522,332.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,461,407.860	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,509,834.900	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,131,886.250	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,935,661.860	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,020,295.550	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,078,396.190	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,825,854.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,048,144.850	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,674,540.450	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,657,500.270	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,940,710.600	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,313,066.640	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,791,518.480	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,364,483.440	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,881,352.600	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,502,678.920	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,369,016.400	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,623,164.080	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,440,937.310	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,355,305.350	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,773,232.140	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,230,890.570	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,563,894.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,125,254.080	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,925,818.280	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,878,780.880	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,947,461.230	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,217,122.320	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,524,245.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,667,087.080	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,358,102.460	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,903,627.090	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,299,438.780	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,151,269.870	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	4,109,764.390	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,514,511.350	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,541,117.120	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,338,677.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	821,173.310	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,637,528.220	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,506,542.040	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,185,440.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,610,539.660	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,644,821.530	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,165,249.920	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,046,446.620	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,730,530.640	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,943,417.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,139,034.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,908,894.850	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,586,325.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,088,590.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,672,484.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,794,278.800	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,855,560.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,474,808.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,585,235.150	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,716,527.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,599,800.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,832,925.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,626,352.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	600,000.000	610,968.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,650,375.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	2,140,000.000	2,343,128.800	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,065,955.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,633,437.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,433,164.300	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,069,959.200	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,434,757.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,823,318.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,961,625.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,065,472.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,504,840.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,067,500.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,172,260.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,067,020.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,607,612.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,071,250.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,542,296.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,470,589.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,977,691.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,194,520.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,132,444.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,276,992.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,113,580.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,574,600.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,666,775.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,583,375.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,035,370.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,194,225.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,753,190.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,420,000.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,009,552.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,659,110.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,401,224.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,473,250.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,823,834.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,963,250.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,765,732.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,049,959.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,171,643.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,384,190.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,429,760.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,648,225.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,100,678.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,930,205.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,652,125.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,650,775.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,309,600.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,102,021.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,678,803.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,298,716.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,774,800.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,842,136.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,979,656.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,795,700.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,217,500.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,800,175.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,298,400.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,318,566.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,066,653.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,346,380.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,153,120.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,866,660.000	



2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,677,925.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,072,300.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,462,620.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,078,270.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,276,560.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,764,825.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,917,206.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,751,550.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,519,648.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,592,260.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,721,875.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,798,679.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,490,950.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,726,382.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,337,502.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,728,585.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,068,604.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,580,500.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,250,530.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,677,170.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,996,868.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,097,000.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,783,140.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,677,725.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,257,351.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,575,845.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,011,102.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,920,288.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,136,240.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,068,070.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,643,350.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,131,010.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,962,843.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,044,140.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,171,300.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,212,407.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,031,540.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,114,200.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,133,800.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,085,410.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,661,125.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,637,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,521,960.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,108,560.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,769,054.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,533,300.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,307,375.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,738,636.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,359,744.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,574,204.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	202,296.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	307,992.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,360,056.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	1,200,000.000	1,208,856.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,506,795.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,616.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,206,368.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,592,992.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,477,002.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,496,290.000	

0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,696,814.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,200,000.000	3,200,096.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	5,700,000.000	5,625,615.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,803,288.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,561,300.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	499,940.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,449,950.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,978,670.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,510,505.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,499,780.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,441,350.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,447,745.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,630.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,371,304.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,499,300.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	798,656.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,553,900.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,878,100.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,932,582.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,453,880.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,438,995.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	2,999,400.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,996,160.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,435,000.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	2,999,160.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,893,120.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,467,730.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,190,970.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,000,000.000	3,003,630.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	6,800,000.000	6,637,412.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,499,020.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,957,160.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,920,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	4,300,000.000	4,053,739.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	3,700,000.000	3,513,816.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	2,999,160.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	5,072,868.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,937,500.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	1,000,000.000	997,300.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 868,109,146.930	

(90,483,016,385)

イギリス・ボンド		イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
2% United Kingdom Gilt 20250907		1,621,000.000	1,775,205.730	
2.5% United Kingdom Gilt 20650722		1,682,000.000	2,740,112.560	
1.5% United Kingdom Gilt 20260722		1,465,000.000	1,585,921.100	
0.5% United Kingdom Gilt 20220722		2,320,000.000	2,342,202.400	
1.5% United Kingdom Gilt 20470722		1,940,000.000	2,218,719.800	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907		2,350,000.000	2,729,243.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722		1,510,000.000	1,938,900.400	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722		2,010,000.000	2,161,091.700	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722		2,000,000.000	2,043,040.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022		1,500,000.000	1,670,850.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022		1,060,000.000	1,462,111.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422		1,800,000.000	1,863,774.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122		1,110,000.000	1,346,929.500	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022		850,000.000	1,034,603.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022		1,800,000.000	1,897,506.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607		2,600,000.000	2,675,894.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022		940,000.000	1,013,526.800	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131		2,300,000.000	2,309,085.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022		2,300,000.000	2,310,902.000	

0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	668,055.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,507,455.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,596,640.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,020,283.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,294,748.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,305,993.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	300,000.000	295,782.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,381,146.130	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,626,029.600	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,781,841.280	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,531,309.100	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,279,963.550	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,855,228.480	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,428,925.580	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,584,660.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,189,923.840	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,622,463.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,496,368.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,325,717.480	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,447,672.640	

	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,916,888.400	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,074,000.000	2,208,852.840	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,580,303.170	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,780,501.120	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,311,681.360	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,241,982.160	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,680,337.120	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,274,439.740	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,204,465.080	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,329,646.110	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 100,888,920.370 (14,219,284,437)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	2,000,000.000	2,662,000.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,115,420.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,965,132.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,184,495.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,227,320.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,450,052.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,963,026.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,022,270.000	



	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,100,000.000	2,852,199.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	2,009,790.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,556,970.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,010,330.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,916,587.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	600,000.000	604,482.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	700,000.000	691,936.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	1,000,000.000	1,000,110.000	
	イスラエル・シケル 小計		イスラエル・シケル 29,232,119.000 (960,275,109)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	3,162,000.000	3,433,457.700	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,004,758.880	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,506,581.810	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	3,473,000.000	3,772,233.680	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,742,220.800	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,498,000.000	3,939,552.540	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,726,630.160	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,248,000.000	3,895,813.600	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,455,648.180	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,527,477.830	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	977,518.080	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,045,224.960	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	3,678,000.000	4,075,224.000	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,490,919.160	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,214,036.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,924,814.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	2,998,424.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	4,870,000.000	5,521,508.600	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,592,648.100	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,950,589.600	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	900,000.000	905,454.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,404,488.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,500,000.000	3,477,880.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,500,000.000	1,368,930.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,900,000.000	1,888,885.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,461,325.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	2,700,000.000	2,698,677.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 73,000,920.680 (5,864,893,968)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル

2.75% Canada Government International Bond 20641201	405,000.000	576,732.150	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,384,280.260	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,733,237.730	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,594,476.840	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,357,393.620	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,814,718.890	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,117,763.330	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,291,755.290	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,508,618.750	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,749,464.500	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,246,954.080	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,019,446.140	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,274,534.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,446,624.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,774,622.500	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,318,944.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,443,964.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,360,658.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,560,000.000	2,917,683.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,372,207.200	

2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,273,968.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,458,618.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,584,481.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	724,241.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,116,434.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,090.350	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,894,508.400	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,304,255.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	701,253.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	900,000.000	868,284.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	500,000.000	493,350.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	500,000.000	499,470.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,502,460.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 50,730,491.230 (4,137,578,864)	
シンガポール・ ドル	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	901,696.000	
3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	824,980.840	
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	682,247.300	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	951,610.520	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	509,000.000	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	711,662.600	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	720,053.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	725,625.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	568,487.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	899,904.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	487,260.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	509,250.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	650,000.000	748,319.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	463,770.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	620,510.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	514,990.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	414,764.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	410,000.000	471,602.500	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	150,000.000	150,195.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,875,927.960 (930,597,715)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	7,227,120.250	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,918,385.400	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,447,034.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,524,096.350	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,680,158.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,832,327.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,909,416.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	3,000,000.000	3,012,480.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 56,551,019.050 (710,280,799)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	25,900,419.600	デンマーク・クローネ
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,144,029.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,703,653.180	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,460,505.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,399,108.300	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,369,660.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	2,367,420.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 63,344,795.080 (1,079,395,308)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,524,858.440	ノルウェー・クローネ
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,425,057.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,657,736.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,480,079.600	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,649,617.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,782,730.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	4,106,525.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,964,784.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 38,591,388.040 (471,586,762)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,534,219.860	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,843,150.500	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,528,685.500	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,320,000.000	3,417,873.600	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	4,043,462.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,090,444.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,512,711.600	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,655,238.000	
	Poland Government Bond 20220725	1,600,000.000	1,599,600.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	1,000,000.000	1,015,290.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,000,000.000	1,002,800.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,147,255.750	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,910,678.750	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	4,133,223.500	

	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,181,632.150	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 47,616,266.410 (1,332,779,296)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,516,661.420	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,348,291.680	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,669,215.280	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,466,569.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	897,356.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	791,080.890	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,034,893.860	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,531,356.510	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,285,327.500	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	698,934.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,133,188.560	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,877,193.270	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,199,939.940	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,347,185.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,364,326.740	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,063,641.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	703,014.000	



3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	100,000.000	102,432.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	802,927.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,292,494.700	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,233,025.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,282,800.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	2,500,000.000	2,604,650.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,364,424.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	708,216.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	702,084.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,087,037.900	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,419,240.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	419,068.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,372,020.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,815,310.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	700,000.000	725,711.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	500,000.000	498,740.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 40,358,356.000 (1,037,209,749)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	23,290,000.000	24,320,349.600	
8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	22,212,563.000	
8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	26,651,240.000	
6.75% Mexican Bonos 20230309	7,200,000.000	7,569,360.000	
8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	33,040,204.290	

	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,646,590.350	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	31,775,004.160	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	12,232,187.820	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	35,826,236.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	20,544,455.520	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	15,015,000.000	17,465,748.300	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,494,434.690	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	22,115,466.960	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	9,221,712.960	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 321,115,553.810 (1,669,800,879)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	614,000.000	685,831.860	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	299,724.120	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	861,282.000	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,904.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	488,066.400	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	776,806.800	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	858,824.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	436,085.700	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	539,755.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	541,630.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	205,290.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	322,121.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	422,044.000	

Finland Government Bond 20300915	500,000.000	518,430.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,497,187.850	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,216,665.520	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,071,610.400	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	395,088.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	915,498.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,369,958.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	1,169,807.400	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	404,740.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	984,078.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,058,351.000	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	819,136.000	
Austria Government Bond 20300220	680,000.000	704,765.600	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,015,770.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	825,181.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	400,148.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	250,000.000	317,010.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,809,876.740	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	2,016,204.220	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,397,438.140	

1% Belgium Government Bond 20260622	2,283,000.000	2,484,771.540	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,645,127.800	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	1,062,444.800	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	1,490,000.000	1,527,205.300	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,197,526.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,097,103.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	933,423.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	494,160.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,470,609.800	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	350,000.000	412,758.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,668,480.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	823,110.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,271,776.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	693,052.800	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,242,876.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,180,458.780	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,727,603.460	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,143,872.300	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,346,625.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,192,499.340	

5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,597,138.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,421,531.550	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,132,014.070	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,476,743.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,898,894.280	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,111,092.860	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,854,487.960	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,302,569.720	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,653,642.240	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,704,515.640	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,476,834.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,913,337.340	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,714,048.050	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,683,257.520	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,555,398.390	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,715,335.280	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,299,515.820	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,307,232.340	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,387,854.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,518,439.040	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,518,494.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,448,598.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,483,793.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	3,285,910.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,060,493.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,705,008.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,358,356.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,154,980.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,750,000.000	1,800,435.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,841,157.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,993,537.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,092,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,000,000.000	1,052,100.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,266,756.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	302,328.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	100,971.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	101,172.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	101,367.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,169,929.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,126,523.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,826,894.300	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,939,691.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,966,560.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,747,889.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,475,672.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,379,925.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,537.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,404,847.350	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,005,069.750	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,992,608.120	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	5,025,980.970	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,532,265.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,789,707.040	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	4,061,866.520	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,667,138.520	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,564,000.000	6,715,146.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,900,629.090	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,841,769.360	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,801,154.500	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,199,000.000	6,379,224.990	

2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,889,338.720	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,439,092.880	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,540,925.180	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,592,819.900	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,887,000.000	7,487,734.170	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,360,975.700	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,667,822.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,510,100.200	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,842,303.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	4,013,538.340	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,629,142.430	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,930,113.900	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,936,696.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,036,480.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,373,818.900	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,740,680.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,700,000.000	3,900,555.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,435,544.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,804,624.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,677,195.000	



0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,424,556.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,473,066.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,410,304.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,750,000.000	3,631,787.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,250,000.000	3,502,167.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,214,228.300	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	3,600,000.000	3,718,260.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,434,512.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,870,000.000	2,062,927.900	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,091,350.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,200,000.000	1,284,432.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,000,000.000	2,058,600.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	639,384.480	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,635,979.870	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,685,000.000	2,870,094.200	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	862,514.310	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,479,000.000	2,733,325.110	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,502,609.340	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,582,908.640	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,471,978.000	

2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,784,645.450	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,660,630.900	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,869,177.150	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,745,207.100	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,208,352.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,400,200.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,430,814.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,266,828.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,280,112.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	1,023,228.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,461,236.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	830,592.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	600,000.000	607,428.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,144,323.300	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,571,538.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,402,954.880	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,001,803.420	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,138,358.630	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,665,766.530	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,661,637.140	

1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,290,188.250	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,080,081.090	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,551,300.800	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	2,090,118.100	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,398,546.900	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,937,095.600	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,769,231.920	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,140,912.360	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,592,160.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,296,819.920	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,805,340.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,705,711.100	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,390,740.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	2,050,000.000	2,091,348.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,724,902.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	3,028,077.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,734,969.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,700,416.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,697,878.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,357,439.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,954,245.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,387,555.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,847,832.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,367,266.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,741,378.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,690,839.900	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,974,475.000	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,583,852.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,314,827.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,350,128.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,336,691.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,671,337.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,052,399.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	746,586.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,326,481.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,452,154.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,934,896.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,614,435.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,047,640.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,498,858.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,085,340.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,656,896.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,321,359.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,782,790.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	800,000.000	819,848.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	800,000.000	886,136.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,300,000.000	1,342,796.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	100,000.000	100,801.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	800,000.000	850,704.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,904,869.060	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,393,442.900	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,855,600.250	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,535,358.100	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,965,465.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,394,143.760	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,546,893.950	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,569,938.840	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,763,664.280	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,547,756.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,136,884.840	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,817,198.760	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,168,348.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,214,458.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,107,965.180	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	3,097,854.970	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,522,551.500	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,516,997.570	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,611,042.820	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,459,489.020	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,650,944.960	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	926,752.210	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,907,266.040	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,271,850.580	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,428,070.560	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,157,457.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,435,312.740	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,538,702.610	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,677,262.300	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,063,227.510	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,292,894.620	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	686,967.840	

3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	685,879.650	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,209,937.440	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	524,962.920	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,114,229.270	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,164,290.840	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	701,701.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,329.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	880,320.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	886,545.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	875,445.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,350,336.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	796,848.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	266,512.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	836,536.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	524,085.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,200,507.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,337,889.480	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,129,616.250	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	840,938.610	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	938,751.600	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	811,984.160	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,084,312.810	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,024,470.930	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,045,183.020	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,015,507.200	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	809,964.780	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	486,744.030	

1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	324,402.000	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	468,585.440	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	643,125.120	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	576,583.550	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,964,819.560	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,227,434.450	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,430,409.320	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,464,904.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,074,433.690	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,924,232.640	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,805,283.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,225,631.100	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,106,249.600	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,117,284.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	2,200,000.000	2,773,166.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,285,442.500	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,629,136.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,120,723.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,908,959.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,452,704.000	



1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,125,967.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,805,136.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,238,537.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,361,226.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,959,796.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,423,008.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,489,864.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	1,500,000.000	1,527,630.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,240,848.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,564,928.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,237,647.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	900,000.000	997,110.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	509,690.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,247,756.690	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,584,806.680	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,899,700.220	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,956,687.420	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,532,972.180	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,700,722.530	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,654,184.450	

	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,111,653.460	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,197,874.580	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,165,239.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,503,912.800	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,199,000.000	2,368,108.930	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,252,005.500	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,356,860.240	
	ユーロ 小計		ユーロ 693,704,141.440 (87,913,125,845)	
国債証券 合計			210,809,825,116 [210,809,825,116]	
合計			210,809,825,116 [210,809,825,116]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 250銘柄	100%	43.0%
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シュケル	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	2.8%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 33銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 328銘柄	100%	41.7%

## 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。

## 「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

	2020年1月10日現在	2021年1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	64,849,132	171,467,266
国債証券	17,604,320,010	22,192,881,490
地方債証券	1,458,385,200	1,557,570,200
特殊債券	729,970,300	832,608,000
社債券	935,292,900	927,958,500
未収利息	34,898,734	38,592,254
前払費用	1,287,679	1,516,499
流動資産合計	20,829,003,955	25,722,594,209
資産合計	20,829,003,955	25,722,594,209
負債の部		
流動負債		
未払金	-	65,432,580
未払解約金	6,121,900	2,455,801
流動負債合計	6,121,900	67,888,381
負債合計	6,121,900	67,888,381
純資産の部		
元本等		
元本	1 16,028,287,542	19,879,992,868
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,794,594,513	5,774,712,960
元本等合計	20,822,882,055	25,654,705,828
純資産合計	20,822,882,055	25,654,705,828

負債純資産合計	20,829,003,955	25,722,594,209
---------	----------------	----------------

## 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1月11日 至 2021年1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	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	13,344,778,620円	16,028,287,542円
期中追加設定元本額	3,594,110,341円	6,073,950,287円
期中一部解約元本額	910,601,419円	2,222,244,961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（FOFs用）（適格機関投資 家専用）	143,275,232円	373,114,786円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,116,709円	- 円
iFree 日本債券イン デックス	136,404,966円	1,030,746,206円
iFree 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,806,325,099円 6,367,336,202円	2,420,708,041円 7,126,335,088円

ダイワ・ライフ・バランス50	3,685,725,233円	4,423,063,248円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,155,900,772円	1,368,806,867円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	937,929,543円	1,101,820,763円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	732,725,273円	815,724,660円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	240,167,951円	271,665,036円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	52,496,870円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	62,292,873円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	9,940,560円	- 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	169,662,829円	422,319,928円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,962,153円	26,998,895円
ダイワつみたてインデックスバランス50	541,071円	9,495,392円
ダイワつみたてインデックスバランス70	957,554円	4,868,661円
ダイワ世界バランスファンド40VA	316,908,449円	293,760,030円
ダイワ世界バランスファンド60VA	202,618,203円	190,565,267円
計	16,028,287,542円	19,879,992,868円
2. 期末日における受益権の総数	16,028,287,542口	19,879,992,868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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	58,561,970	35,194,870
地方債証券	2,008,300	1,514,300
特殊債券	204,700	960,300
社債券	296,700	818,200
合計	56,645,670	38,487,670

(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1月10日まで、及び2020年12月1日から2021年1月12日まで)を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2021年1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）

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.2991円	1.2905円
（1万口当たり純資産額）	（12,991円）	（12,905円）

附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 0 9 2年国債	40,000,000	40,094,800	
	4 1 3 2年国債	120,000,000	120,390,000	
	4 1 4 2年国債	170,000,000	170,584,800	
	4 1 5 2年国債	100,000,000	100,364,000	
	4 1 6 2年国債	20,000,000	20,076,800	
	4 1 7 2年国債	130,000,000	130,513,500	
	4 1 8 2年国債	160,000,000	160,678,400	
	4 1 9 2年国債	130,000,000	130,562,900	
	1 3 1 5年国債	190,000,000	190,494,000	
	1 3 2 5年国債	190,000,000	190,611,800	
	1 3 3 5年国債	230,000,000	230,892,400	
	1 3 4 5年国債	170,000,000	170,756,500	
	1 3 5 5年国債	400,000,000	401,968,000	
	1 3 6 5年国債	300,000,000	301,683,000	
	1 3 7 5年国債	410,000,000	412,537,900	
	1 3 8 5年国債	400,000,000	402,708,000	
	1 3 9 5年国債	320,000,000	322,297,600	
	1 4 0 5年国債	190,000,000	191,472,500	
	1 4 1 5年国債	270,000,000	272,246,400	

1 4 2	5年国債	40,000,000	40,355,600	
1 4 3	5年国債	280,000,000	282,646,000	
1 4 4	5年国債	200,000,000	202,004,000	
1 4 5	5年国債	120,000,000	121,214,400	
1	40年国債	30,000,000	43,587,000	
2	40年国債	38,000,000	53,559,480	
3	40年国債	19,000,000	26,916,730	
4	40年国債	40,000,000	56,936,000	
5	40年国債	35,000,000	48,250,650	
6	40年国債	40,000,000	54,392,400	
7	40年国債	31,000,000	40,604,420	
8	40年国債	33,000,000	40,488,030	
9	40年国債	40,000,000	36,716,000	
1 0	40年国債	91,000,000	97,950,580	
1 1	40年国債	85,000,000	88,684,750	
1 2	40年国債	99,000,000	93,315,420	
1 3	40年国債	141,000,000	132,941,850	
3 2 1	10年国債	65,000,000	65,860,600	
3 2 2	10年国債	140,000,000	141,688,400	
3 2 3	10年国債	70,000,000	71,024,800	
3 2 4	10年国債	80,000,000	81,056,000	
3 2 5	10年国債	160,000,000	162,484,800	
3 2 6	10年国債	20,000,000	20,317,800	
3 2 7	10年国債	90,000,000	91,604,700	
3 2 8	10年国債	60,000,000	60,944,400	
3 2 9	10年国債	200,000,000	204,514,000	
3 3 0	10年国債	81,000,000	83,007,180	
3 3 1	10年国債	10,000,000	10,195,300	
3 3 2	10年国債	65,000,000	66,378,000	
3 3 3	10年国債	83,000,000	84,907,340	
3 3 4	10年国債	320,000,000	327,939,200	
3 3 5	10年国債	210,000,000	214,817,400	
3 3 7	10年国債	260,000,000	264,316,000	
3 3 8	10年国債	80,000,000	81,747,200	
3 3 9	10年国債	115,000,000	117,691,000	
3 4 0	10年国債	190,000,000	194,653,100	
3 4 1	10年国債	15,000,000	15,305,100	
3 4 2	10年国債	60,000,000	60,640,200	
3 4 3	10年国債	180,000,000	182,016,000	



344	10年国債	50,000,000	50,571,500
345	10年国債	320,000,000	323,817,600
346	10年国債	40,000,000	40,484,800
347	10年国債	235,000,000	237,888,150
348	10年国債	240,000,000	242,983,200
349	10年国債	250,000,000	253,225,000
350	10年国債	230,000,000	232,990,000
351	10年国債	220,000,000	222,877,600
352	10年国債	255,000,000	258,248,700
353	10年国債	240,000,000	243,060,000
354	10年国債	210,000,000	212,587,200
355	10年国債	125,000,000	126,480,000
356	10年国債	185,000,000	187,092,350
357	10年国債	105,000,000	106,079,400
358	10年国債	235,000,000	237,265,400
359	10年国債	240,000,000	242,148,000
360	10年国債	291,000,000	293,249,430
2	30年国債	9,000,000	10,976,400
3	30年国債	4,000,000	4,860,000
4	30年国債	8,000,000	10,265,440
5	30年国債	8,000,000	9,780,720
6	30年国債	9,000,000	11,270,610
7	30年国債	12,000,000	14,995,800
10	30年国債	15,000,000	16,774,800
11	30年国債	9,000,000	10,735,380
12	30年国債	11,000,000	13,695,660
13	30年国債	11,000,000	13,590,610
14	30年国債	22,000,000	28,397,820
15	30年国債	21,000,000	27,479,970
16	30年国債	26,000,000	34,124,480
17	30年国債	17,000,000	22,145,050
18	30年国債	20,000,000	25,845,000
19	30年国債	15,000,000	19,432,350
20	30年国債	16,000,000	21,234,720
21	30年国債	16,000,000	20,827,040
22	30年国債	17,000,000	22,677,150
23	30年国債	16,000,000	21,412,960
24	30年国債	15,000,000	20,124,150
25	30年国債	17,000,000	22,340,210

26	30年国債	32,000,000	42,633,280
27	30年国債	32,000,000	43,358,400
28	30年国債	34,000,000	46,296,780
29	30年国債	43,000,000	58,115,790
30	30年国債	56,000,000	74,985,680
31	30年国債	76,000,000	100,746,360
32	30年国債	45,000,000	60,717,600
33	30年国債	95,000,000	123,412,600
34	30年国債	70,000,000	93,879,100
35	30年国債	92,000,000	120,235,720
36	30年国債	88,000,000	115,380,320
37	30年国債	100,000,000	129,543,000
38	30年国債	65,000,000	83,116,150
39	30年国債	58,000,000	75,443,500
40	30年国債	44,000,000	56,342,440
41	30年国債	45,000,000	56,752,650
42	30年国債	53,000,000	66,906,140
43	30年国債	55,000,000	69,499,650
44	30年国債	50,000,000	63,241,500
45	30年国債	57,000,000	69,555,960
46	30年国債	90,000,000	109,889,100
47	30年国債	62,000,000	77,185,040
48	30年国債	68,000,000	81,626,520
49	30年国債	68,000,000	81,658,480
50	30年国債	60,000,000	63,598,800
51	30年国債	75,000,000	70,580,250
52	30年国債	69,000,000	68,069,880
53	30年国債	75,000,000	75,678,750
54	30年国債	64,000,000	67,584,000
55	30年国債	96,000,000	101,304,000
56	30年国債	60,000,000	63,269,400
57	30年国債	70,000,000	73,672,900
58	30年国債	75,000,000	78,873,750
59	30年国債	55,000,000	56,428,350
60	30年国債	58,000,000	62,352,900
61	30年国債	50,000,000	51,135,000
62	30年国債	46,000,000	44,621,840
63	30年国債	65,000,000	61,246,900
64	30年国債	65,000,000	61,070,750

6 5	3 0 年国債	55,000,000	51,588,350	
6 6	3 0 年国債	87,000,000	81,564,240	
6 7	3 0 年国債	67,000,000	66,253,620	
6 8	3 0 年国債	60,000,000	59,326,800	
5 5	2 0 年国債	41,000,000	42,029,920	
5 6	2 0 年国債	12,000,000	12,365,040	
5 7	2 0 年国債	24,000,000	24,695,760	
5 8	2 0 年国債	35,000,000	36,196,650	
5 9	2 0 年国債	3,000,000	3,106,140	
6 1	2 0 年国債	40,000,000	40,979,200	
6 2	2 0 年国債	16,000,000	16,361,120	
6 3	2 0 年国債	30,000,000	31,409,100	
6 4	2 0 年国債	35,000,000	36,904,350	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	44,498,160	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	31,695,900	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	20,225,310	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	26,851,750	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	12,850,560	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	19,563,480	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	18,359,490	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	57,354,480	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,302,700	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	27,116,250	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	18,526,260	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	15,319,220	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	71,475,300	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	30,921,240	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	34,551,670	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,749,880	
8 7	2 0 年国債	35,000,000	39,191,950	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	37,326,300	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	16,884,450	
9 2	2 0 年国債	45,000,000	50,894,550	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	20,338,200	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	51,124,950	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	34,639,200	
9 6	2 0 年国債	23,000,000	26,259,100	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	28,840,500	
9 8	2 0 年国債	34,000,000	38,994,600	

99	20年国債	53,000,000	61,077,730
100	20年国債	35,000,000	40,748,400
101	20年国債	18,000,000	21,216,240
102	20年国債	10,000,000	11,845,500
103	20年国債	21,000,000	24,718,680
104	20年国債	64,000,000	74,376,320
105	20年国債	38,000,000	44,336,880
106	20年国債	16,000,000	18,791,680
107	20年国債	20,000,000	23,434,600
108	20年国債	68,000,000	78,593,720
109	20年国債	60,000,000	69,610,800
110	20年国債	27,000,000	31,768,470
111	20年国債	35,000,000	41,633,550
112	20年国債	40,000,000	47,242,800
113	20年国債	70,000,000	82,982,900
114	20年国債	45,000,000	53,514,450
115	20年国債	42,000,000	50,322,300
116	20年国債	27,000,000	32,468,310
117	20年国債	77,000,000	91,887,180
118	20年国債	13,000,000	15,445,170
119	20年国債	23,000,000	26,892,520
120	20年国債	75,000,000	86,278,500
123	20年国債	42,000,000	50,636,040
124	20年国債	100,000,000	119,571,000
125	20年国債	25,000,000	30,490,750
126	20年国債	21,000,000	25,186,140
127	20年国債	70,000,000	83,243,300
128	20年国債	32,000,000	38,163,840
129	20年国債	95,000,000	112,312,800
130	20年国債	28,000,000	33,190,080
131	20年国債	70,000,000	82,231,800
132	20年国債	25,000,000	29,437,750
133	20年国債	90,000,000	106,953,300
134	20年国債	15,000,000	17,868,900
135	20年国債	20,000,000	23,603,400
136	20年国債	80,000,000	93,526,400
137	20年国債	18,000,000	21,291,480
139	20年国債	120,000,000	140,584,800
140	20年国債	20,000,000	23,709,600

1 4 1	2 0 年国債	48,000,000	57,023,520	
1 4 2	2 0 年国債	140,000,000	167,969,200	
1 4 3	2 0 年国債	48,000,000	56,562,240	
1 4 4	2 0 年国債	70,000,000	81,645,900	
1 4 5	2 0 年国債	130,000,000	155,066,600	
1 4 6	2 0 年国債	115,000,000	137,444,550	
1 4 7	2 0 年国債	145,000,000	171,784,400	
1 4 8	2 0 年国債	110,000,000	129,110,300	
1 4 9	2 0 年国債	140,000,000	164,561,600	
1 5 0	2 0 年国債	115,000,000	133,826,650	
1 5 1	2 0 年国債	135,000,000	153,612,450	
1 5 2	2 0 年国債	120,000,000	136,641,600	
1 5 3	2 0 年国債	140,000,000	161,488,600	
1 5 4	2 0 年国債	110,000,000	125,423,100	
1 5 5	2 0 年国債	120,000,000	133,340,400	
1 5 6	2 0 年国債	103,000,000	105,258,790	
1 5 7	2 0 年国債	113,000,000	111,910,680	
1 5 8	2 0 年国債	140,000,000	144,844,000	
1 5 9	2 0 年国債	120,000,000	125,953,200	
1 6 0	2 0 年国債	130,000,000	138,344,700	
1 6 1	2 0 年国債	80,000,000	83,824,000	
1 6 2	2 0 年国債	100,000,000	104,683,000	
1 6 3	2 0 年国債	98,000,000	102,489,380	
1 6 4	2 0 年国債	125,000,000	128,558,750	
1 6 5	2 0 年国債	95,000,000	97,581,150	
1 6 6	2 0 年国債	115,000,000	121,905,750	
1 6 7	2 0 年国債	100,000,000	102,444,000	
1 6 8	2 0 年国債	110,000,000	110,562,100	
1 6 9	2 0 年国債	80,000,000	78,829,600	
1 7 0	2 0 年国債	85,000,000	83,594,100	
1 7 1	2 0 年国債	70,000,000	68,707,100	
1 7 2	2 0 年国債	105,000,000	104,906,550	
1 7 3	2 0 年国債	105,000,000	104,811,000	
1 7 4	2 0 年国債	110,000,000	109,699,700	
国債証券 合計			22,192,881,490	
地方債証券	7 5 1 東京都公債	100,000,000	101,695,200	
	2 7 - 1 5 北海道公債	100,000,000	100,934,200	
	2 2 2 神奈川県公債	100,000,000	100,124,700	
	4 0 1 大阪府公債	100,000,000	102,120,500	

	3 兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	102,203,600	
	1 1 兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	116,261,600	
	2 8 - 1 静岡県公債	100,000,000	100,242,500	
	2 4 - 1 6 愛知県公債	100,000,000	101,474,200	
	2 2 - 1 福岡県 1 5 年	100,000,000	107,960,000	
	2 9 - 6 千葉県公債	100,000,000	101,168,500	
	1 1 6 共同発行地方	100,000,000	101,432,200	
	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	101,323,700	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,942,900	
	2 5 - 6 大阪市公債	100,000,000	101,867,000	
	1 1 名古屋市 2 0 年	100,000,000	117,819,400	
地方債証券 合計			1,557,570,200	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	107,770,600	
	8 1 政保道路機構	100,000,000	116,913,800	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	101,346,200	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	101,794,900	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	101,803,400	
	3 6 地方公共団体	100,000,000	101,167,800	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,827,800	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,983,500	
特殊債券 合計			832,608,000	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,880,800	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	101,746,500	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,304,000	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,136,800	
	5 N T Tファイナンス	100,000,000	101,742,300	
	8 0 三菱地所	100,000,000	112,871,700	
	3 2 東日本旅客鉄道	100,000,000	107,015,000	
	9 ソフトバンク	100,000,000	99,489,000	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	103,772,400	
社債券 合計			927,958,500	
合計			25,511,018,190	

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,087,698,334	2,300,839,495
コール・ローン	476,910,969	293,597,486
投資証券	89,388,682,897	71,396,328,391
派生商品評価勘定	-	16,001
未収入金	1,037,881,420	139,271,654
未収配当金	287,547,853	240,890,128
流動資産合計	92,278,721,473	74,370,943,155
資産合計	92,278,721,473	74,370,943,155
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	689,728	46,840
未払金	351,405,923	63,754,018
未払解約金	224,078,000	160,219,000
流動負債合計	576,173,651	224,019,858
負債合計	576,173,651	224,019,858
純資産の部		
元本等		
元本	1 33,163,733,156	28,120,093,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,538,814,666	46,026,829,542
元本等合計	91,702,547,822	74,146,923,297
純資産合計	91,702,547,822	74,146,923,297
負債純資産合計	92,278,721,473	74,370,943,155

## 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1月11日 至 2021年1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	<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>
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	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	40,758,891,506円	33,163,733,156円
期中追加設定元本額	201,703,741円	539,057,501円
期中一部解約元本額	7,796,862,091円	5,582,696,902円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)	29,514,785,392円	24,518,016,919円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	27,600,624円	26,764,856円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	14,473,027円	13,633,448円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	12,969,327円	11,440,763円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	66,444,416円	61,279,250円
6資産バランスファンド(分配型)	121,337,152円	119,337,671円
6資産バランスファンド(成長型)	290,956,882円	282,534,099円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,382,735,184円	1,239,966,499円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	38,159,377円	36,275,419円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	3,382,852円	2,798,510円
常陽3分法ファンド	168,809,724円	156,851,444円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	39,619,502円	37,765,258円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	265,291,377円	325,929,946円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	345,957,189円	396,866,111円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	454,017,584円	526,567,569円

ダイワ・グローバルREIT ファンド（ダイワSMA専 用）	19,380,214円	- 円
ライフハーモニー（ダイワ世 界資産分散ファンド）（分配 型）	349,465,022円	313,498,363円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（部分為替ヘッジあ り）	21,643,551円	24,036,038円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（為替ヘッジなし）	26,704,760円	26,531,592円
計	33,163,733,156円	28,120,093,755円
2. 期末日における受益権の総数	33,163,733,156口	28,120,093,755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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,280,869,414	2,490,934,190
合計	2,280,869,414	2,490,934,190

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年9月18日から2020年1月10日まで、及び2020年9月16日から2021年1月12日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2021年1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	370,612,279	-	371,272,279	660,000	203,069,257	-	203,053,256	16,001

アメリカ・ドル	218,420,000	-	219,080,000	660,000	63,797,604	-	63,791,484	6,120
イギリス・ポンド	-	-	-	-	139,271,653	-	139,261,772	9,881
ユーロ	152,192,279	-	152,192,279	0	-	-	-	-
買建	152,192,279	-	152,162,551	29,728	203,069,257	-	203,022,417	46,840
アメリカ・ドル	152,192,279	-	152,162,551	29,728	139,271,653	-	139,268,399	3,254
ユーロ	-	-	-	-	63,797,604	-	63,754,018	43,586
合計	522,804,558	-	523,434,830	689,728	406,138,514	-	406,075,673	30,839

## (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1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額	2.7651円	2.6368円
(1万口当たり純資産額)	(27,651円)	(26,368円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	244,601	20,336,127.140	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,777	3,528,104.850	
		EQUINIX INC	27,971	19,087,130.690	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	689,339	9,905,801.430	
		CYRUSONE INC	198,334	13,694,962.700	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	234,015	6,201,397.500	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	141,756	2,398,511.520	
		INVITATION HOMES INC	398,505	11,576,570.250	
		AMERICOLD REALTY TRUST	197,746	6,891,448.100	
		VICI PROPERTIES INC	612,570	15,522,523.800	
		APARTMENT INCOME REIT CO	130,104	4,800,837.600	
		VENTAS INC	357,776	16,529,251.200	
		WEYERHAEUSER CO	129,012	4,270,297.200	
		VEREIT INC	377,427	13,228,816.350	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142,579	5,359,544.610	
		SUN COMMUNITIES INC	85,181	12,276,285.720	
		PROLOGIS INC	195,191	18,476,780.060	
		SITE CENTERS CORP	209,310	2,122,403.400	
		DUKE REALTY CORP	537,176	20,595,327.840	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	57,808	13,369,834.240	
		WELLTOWER INC	302,728	18,520,899.040	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	513,535	14,620,341.450	
		KILROY REALTY CORP	89,840	4,911,552.800	
		PUBLIC STORAGE	111,428	24,653,445.000	
		UDR INC	360,402	13,352,894.100	
		WP CAREY INC	101,915	6,764,098.550	
		AGREE REALTY CORP	51,679	3,321,409.330	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	149,531	5,259,005.270	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,005	3,282,406.350	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	110,391	12,292,037.850	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	302,493	6,306,979.050		
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 333,457,024.990 (34,756,225,716)	
イギリス・ポンド				イギリス・ポンド	
		ASSURA PLC	6,719,572	5,227,827.010	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,592,875	10,482,710.370	

	SEGRO PLC	1,450,083	13,848,292.650	
	UNITE GROUP PLC/THE	211,682	2,098,827.030	
	DERWENT LONDON PLC	115,040	3,527,126.400	
	WORKSPACE GROUP PLC	330,933	2,427,393.550	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	628,741	5,114,808.030	
	BIG YELLOW GROUP PLC	237,024	2,555,118.720	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,159,246	2,677,858.260	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,447,617	4,075,282.300	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 52,035,244.320 (7,333,847,335)	
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	6,252,486	11,754,673.680	
	MIRVAC GROUP	13,747,513	35,331,108.410	
	GOODMAN GROUP	2,140,727	38,704,344.160	
	CHARTER HALL GROUP	2,479,244	34,312,736.960	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,359,390	11,348,665.900	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 131,451,529.110 (10,560,815,849)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384,355	カナダ・ドル 14,455,591.550	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 14,455,591.550 (1,178,998,046)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	4,931,141	13,511,326.340	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	5,452,100	8,014,587.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	11,313,632	25,568,808.320	
	KEPPEL REIT	8,281,800	9,441,252.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,649,977	18,041,910.760	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 74,577,884.420 (5,843,923,023)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,335,416	ニュージーランド・ドル 9,841,394.320	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル	

			9,841,394.320	
			(735,742,639)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	524,189	7,354,371.670	
	NSI NV	82,711	2,754,276.300	
	ICADE	112,987	7,044,739.450	
	ARGAN	39,266	3,376,876.000	
	GECINA SA	45,520	5,621,720.000	
	KLEPIERRE	553,055	10,225,986.950	
	COVIVIO	104,785	7,759,329.250	
	AEDIFICA	122,948	11,852,187.200	
	COFINIMMO	24,034	2,965,795.600	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	52,533	1,494,038.520	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	71,563	3,542,368.500	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	324,884	2,473,991.660	
ユーロ 小計			ユーロ	
			66,465,681.100	
			(8,423,195,766)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	2,728,792	190,742,560.800	
香港・ドル 小計			香港・ドル	
			190,742,560.800	
			(2,563,580,017)	
投資証券 合計			71,396,328,391	
			[71,396,328,391]	
合計			71,396,328,391	
			[71,396,328,391]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 31銘柄	100%	48.6%
イギリス・ポンド	投資証券 10銘柄	100%	10.3%
オーストラリア・ドル	投資証券 5銘柄	100%	14.8%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.7%
シンガポール・ドル	投資証券 5銘柄	100%	8.2%

ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	100%	1.0%
ユーロ	投資証券	12銘柄	100%	11.8%
香港・ドル	投資証券	1銘柄	100%	3.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1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	1,990,247,834	3,328,335,509
投資証券	2 111,334,726,250	91,762,233,400
派生商品評価勘定	-	124,649,740
未収入金	1,525,032,576	784,288,170
未収配当金	873,164,339	603,800,856
前払金	38,493,600	-
流動資産合計	115,761,664,599	96,603,307,675
資産合計	115,761,664,599	96,603,307,675
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,995,120	12,200
前受金	-	127,984,000
未払金	525,356,141	658,719,029
未払解約金	51,932,000	19,058,000
流動負債合計	612,283,261	805,773,229
負債合計	612,283,261	805,773,229
純資産の部		
元本等		
元本	1 35,358,466,590	32,599,135,387



剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	79,790,914,748	63,198,399,059
元本等合計	115,149,381,338	95,797,534,446
純資産合計	115,149,381,338	95,797,534,446
負債純資産合計	115,761,664,599	96,603,307,675

## 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1月11日 至 2021年1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	<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、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	40,074,865,523円	35,358,466,590円
期中追加設定元本額	4,247,554,247円	37,389,612,621円
期中一部解約元本額	8,963,953,180円	40,148,943,824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 )	- 円	29,826,184,382円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	12,326,378円	12,713,653円
インカム重視ポートフォリオ ( 奇数月分配型 )	10,602,515円	10,771,748円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	54,126,491円	55,980,030円
6資産バランスファンド(分 配型)	101,070,889円	110,059,334円
6資産バランスファンド(成 長型)	237,160,019円	260,481,037円
世界6資産均等分散ファンド ( 毎月分配型 )	31,708,419円	33,452,934円
『しがぎん』S R I三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	1,384,668円	1,277,759円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	33,022,502円	34,477,349円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	223,340,105円	299,003,468円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	291,080,539円	365,816,395円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	380,661,232円	487,272,518円
D CダイワJ - R E I Tアク ティブファンド	346,345,424円	334,817,219円
ダイワファンドラップ J- REITセレクト	32,902,728,027円	- 円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(成長 型)	72,408,222円	77,108,060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)	25,369,900円	26,418,611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）	118,696,450円	121,041,776円
	ダイワ・アクティブリート・ファンド（年4回決算型）	516,434,810円	542,259,114円
計		35,358,466,590円	32,599,135,387円
2.	期末日における受益権の総数	35,358,466,590口	32,599,135,387口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 722,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,001,000,000円

## （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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	1,282,023,811	4,113,981,136
合計	1,282,023,811	4,113,981,136

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年11月12日から2020年1月10日まで、及び2020年11月11日から2021年1月12日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2020年1月10日 現在			2021年1月12日 現在			
	契約額等		時価	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000
合計	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600	2,672,892,000	-	2,797,704,000	124,812,000

(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)

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額	3.2566円	2.9387円
(1万口当たり純資産額)	(32,566円)	(29,387円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	2,326	283,306,800	
	サンケイリアルエステート	4,560	466,944,000	
	SOSILA物流リート投	7,498	949,246,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	2,430	1,404,540,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	9,805	899,118,500	
	森ヒルズリート	10,137	1,499,262,300	
	産業ファンド	15,495	3,083,505,000	
	アドバンス・レジデンス	12,125	3,849,687,500	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	17,090	3,136,015,000	
A P I 投資法人	1,544	660,060,000	
G L P 投資法人	23,970	4,072,503,000	
コンフォリア・レジデンシャル	2,509	737,395,100	
日本プロロジスリート	17,205	5,686,252,500	
O N E リート投資法人	1,650	429,495,000	
イオンリート投資	13,983	1,869,527,100	
ヒューリックリート投資法	10,558	1,590,034,800	
日本リート投資法人	4,550	1,628,900,000	
積水ハウス・リート投資	21,800	1,621,920,000	
トーセイ・リート投資法人	1,902	215,116,200	
ケネディクス商業リート	3,517	876,788,100	
ヘルスケア&メディカル投資	4,759	628,188,000	
野村不動産マスターF	36,120	5,403,552,000	
ラサールロジポート投資	14,077	2,383,236,100	
スターアジア不動産投	10,092	496,021,800	
三井不ロジパーク	5,832	3,009,312,000	
大江戸温泉リート	1,263	86,894,400	
森トラスト・ホテルリート投	1,623	183,236,700	
三菱地所物流REIT	3,085	1,308,040,000	
CREロジスティクスファンド	102	15,412,200	
ザイマックス・リート	10,007	980,686,000	
伊藤忠アドバンスロジ	783	104,608,800	
日本ビルファンド	14,537	8,576,830,000	
ジャパンリアルエステイト	10,543	6,199,284,000	
日本リテールファンド	19,219	3,518,998,900	
オリックス不動産投資	17,134	2,796,268,800	
日本プライムリアルティ	4,114	1,396,703,000	
プレミア投資法人	2,284	285,500,000	
東急リアル・エステート	7,669	1,223,972,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	27,095	3,462,741,000	
森トラスト総合リート	3,304	433,815,200	
インヴィンシブル投資法人	40,402	1,315,085,100	
フロンティア不動産投資	1,962	780,876,000	
福岡リート投資法人	1,171	178,226,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,493	1,685,268,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,522	639,150,000	
大和証券オフィス投資法人	1,950	1,259,700,000	
阪急阪神リート投資法人	7,784	975,335,200	

	大和ハウスリート投資法人	18,815	4,950,226,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,288	689,647,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	14,781	1,835,800,200	
投資証券	合計		91,762,233,400	
合計			91,762,233,400	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド 700口 ジャパンリアルエステイト 1,000口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ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

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	79,742,449	44,929,876
コール・ローン	40,491,484	22,731,207
株式	2,225,803,957	2,645,193,418
ハイブリッド優先証券	516,369,020	471,463,756
投資証券	31,258,784	23,931,896
未収入金	7,026,310	-
未収配当金	3,548,576	2,588,753
未収利息	559,087	559,222
流動資産合計	2,904,799,667	3,211,398,128
資産合計	2,904,799,667	3,211,398,128
負債の部		
流動負債		
未払金	37,843,613	2,343,468

未払解約金		6,550,000	518,000
流動負債合計		44,393,613	2,861,468
負債合計		44,393,613	2,861,468
純資産の部			
元本等			
元本	1	922,190,111	946,303,989
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,938,215,943	2,262,232,671
元本等合計		2,860,406,054	3,208,536,660
純資産合計		2,860,406,054	3,208,536,660
負債純資産合計		2,904,799,667	3,211,398,128

## 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1月11日 至 2021年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 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)ハイブリッド優先証券</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>(3)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>
<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>(1)受取配当金</p> <p>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</p> <p>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>
<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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	889,650,063円	922,190,111円
期中追加設定元本額	124,557,329円	121,921,838円
期中一部解約元本額	92,017,281円	97,807,960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)	8,728,464円	7,140,495円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	7,563,461円	6,125,953円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	140,259,669円	116,510,790円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	23,648,064円	19,740,852円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	23,593,216円	20,323,891円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	116,753,865円	132,401,213円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	227,747,249円	242,195,048円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	373,896,123円	401,865,747円
計	922,190,111円	946,303,989円
2. 期末日における受益権の総数	922,190,111口	946,303,989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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）

株式	168,277,621	241,947,263
ハイブリッド優先証券	4,024,245	5,025,048
投資証券	292,299	132,093
合計	172,594,165	237,054,308

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年10月16日から2020年1月10日まで、及び2020年10月16日から2021年1月12日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2021年1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)

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1018円 (31,018円)	3.3906円 (33,906円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABORATORIES	2,584	110.840	286,410.560	
	ADOBE INC	1,002	474.240	475,188.480	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	833	283.130	235,847.290	
	DOLLAR TREE INC	1,154	112.430	129,744.220	
	ALBEMARLE CORP	1,213	177.290	215,052.770	
	DANAHER CORP	1,281	244.120	312,717.720	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,605	117.650	424,128.250	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,737	52.040	246,513.480	
	TE CONNECTIVITY LTD	1,558	130.470	203,272.260	
	APPLE INC	7,316	128.980	943,617.680	
	BOEING CO/THE	1,252	206.790	258,901.080	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,759	57.460	733,132.140		

JPMORGAN CHASE & CO	6,100	138.050	842,105.000
CATERPILLAR INC	1,351	193.860	261,904.860
MORGAN STANLEY	4,859	76.060	369,575.540
BROADCOM INC	1,289	445.760	574,584.640
DEERE & CO	991	294.920	292,265.720
TELEFLEX INC	554	403.860	223,738.440
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,729	82.140	224,160.060
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,094	90.910	281,275.540
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	902	217.000	195,734.000
AMAZON.COM INC	298	3,114.210	928,034.580
EXXON MOBIL CORP	5,396	46.840	252,748.640
NEXTERA ENERGY INC	3,232	79.690	257,558.080
GENERAL ELECTRIC CO	16,823	11.450	192,623.350
GENERAL MOTORS CO	5,775	45.010	259,932.750
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,264	293.830	371,401.120
ALPHABET INC-CL A	131	1,756.290	230,073.990
FIRSTENERGY CORP	42,568	30.200	1,285,553.600
HOME DEPOT INC	1,083	271.230	293,742.090
JOHNSON & JOHNSON	3,917	159.370	624,252.290
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	4,579	85.830	393,015.570
MCDONALD'S CORP	1,423	214.230	304,849.290
FACEBOOK INC-CLASS A	850	256.840	218,314.000
CONCHO RESOURCES INC	3,970	66.200	262,814.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,138	173.690	197,659.220
MERCK & CO. INC.	2,196	85.000	186,660.000
NIKE INC -CL B	1,257	147.050	184,841.850
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,515	254.370	385,370.550
NORTHROP GRUMMAN CORP	829	294.740	244,339.460
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,332	82.310	191,946.920
PFIZER INC	8,571	37.770	323,726.670
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,643	137.850	226,487.550
VIATRIS INC	1,063	18.470	19,633.610
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,570	171.310	268,956.700
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,577	161.860	417,113.220
ANTHEM INC	1,475	338.770	499,685.750
WALT DISNEY CO/THE	1,801	179.090	322,541.090
WASTE MANAGEMENT INC	2,982	117.040	349,013.280
WALMART INC	894	147.290	131,677.260

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,724	413.790	713,373.960	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,435	199.230	285,895.050	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,730	212.890	794,079.700	
NVIDIA CORP	330	544.860	179,803.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,741	159.380	436,860.580	
TYSON FOODS INC-CL A	3,574	64.770	231,487.980	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	798	513.350	409,653.300	
MASTERCARD INC - A	2,228	348.200	775,789.600	
BANK OF AMERICA CORP	17,047	33.070	563,744.290	
EATON CORP PLC	2,671	126.960	339,110.160	
ECOLAB INC	1,075	221.060	237,639.500	
INTEL CORP	6,358	51.540	327,691.320	
MICROSOFT CORP	5,832	217.490	1,268,401.680	
MEDTRONIC PLC	3,337	118.500	395,434.500	
MICRON TECHNOLOGY INC	5,043	78.670	396,732.810	
COMCAST CORP-CLASS A	4,431	51.520	228,285.120	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 25,138,419.560 (2,620,177,471)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
ENBRIDGE INC	7,222	42.470	306,718.340	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 306,718.340 (25,015,947)	
合計			2,645,193,418 [2,645,193,418]	

## (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
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		CHS INC 7.5 4	4,575.000	131,988.750	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4,200.000	107,058.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	2,929.000	74,074.410	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	2,175.000	55,060.120	
		STATE STREET CORP 5.35 G	914.000	25,135.000	

REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2,558.000	71,905.380	
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4,550.000	116,753.000	
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	31,020.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	30,660.000	
MORGAN STANLEY 5.85 K	1,433.000	39,866.060	
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2,100.000	53,886.000	
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2,582.000	67,777.500	
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2,076.000	53,290.920	
SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	51,495.860	
ENBRIDGE INC 6.375 B	497.000	13,175.470	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2,725.000	73,602.250	
UNUM GROUP 6.25	3,350.000	87,910.700	
RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75 F	6,450.000	176,665.500	
KKR & CO INC 6.5 B	750.000	19,455.000	
KEYCORP 5.65 F	952.000	25,009.040	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	4,088.000	110,621.280	
NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	78,089.900	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2,450.000	67,375.000	
CMS ENERGY CORP 5.875	3,224.000	87,080.240	
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5,825.000	158,614.750	
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	1,818.000	50,285.880	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,746.000	49,455.450	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	909.000	24,952.050	
SPIRE INC 5.9 A	3,556.000	97,434.400	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	2,100.000	59,220.000	
VOYA FINANCIAL INC 5.35 B	638.000	17,672.600	
TCF FINANCIAL 5.7 C*	400.000	10,464.000	
ALLSTATE CORP 5.1 H	4,375.000	114,625.000	
SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	172,092.020	
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1,923.000	51,094.110	
BANK OF AMERICA CORP 5 LL	4,412.000	114,447.280	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6,414.000	164,903.940	

		SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	6,734.000	176,094.100	
		FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3,025.000	77,016.500	
		METLIFE INC 4.75 F	2,525.000	64,488.500	
		SOUTHERN CO 4.95 2020	8,035.000	209,793.850	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	8,561.000	215,052.320	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	1,604.000	40,132.080	
		DIME COMMUNITY BANCSHRS 5.5 A	2,375.000	59,541.250	
		ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	1,950.000	53,196.000	
		TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	3,578.000	93,600.480	
		UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2,560.000	66,611.200	
		SOUTHERN CO 4.2 C	2,625.000	66,360.000	
		BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	1,675.000	41,523.250	
		BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	1,700.000	43,367.000	
		US CELLULAR CORP 5.5	1,750.000	43,172.500	
		REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	1,444.000	37,011.160	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	2,589.000	71,870.640	
		ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1,963.000	51,312.820	
		WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1,556.000	43,925.880	
		PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,900.000	50,540.000	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	2,890.000	80,775.500	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	7,760.000	203,700.000	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 4,523,301.890 (471,463,756)	
		ハイブリッド優先証券 合計		471,463,756 [471,463,756]	
投資証券	アメリカ・ドル	UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1,200	30,156.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	2,875	72,018.750	



	SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1,350	34,884.000	
	QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	31,466.500	
	AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	1,363	36,051.350	
	TAUBMAN CENTERS INC 6.5 J	1,000	25,030.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 229,606.600 (23,931,896)	
投資証券 合計			23,931,896 [23,931,896]	
合計			495,395,652 [495,395,652]	

ハイブリッド優先証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入ハイ ブリッド 優先証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 66銘柄 ハイブリッド 優先証券 58銘柄 投資証券 6銘柄	84.1%	15.1%	0.8%	99.2%
カナダ・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	-%	0.8%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,071,420	33,439,138
コール・ローン	5,555,987	13,703,260
株式	1,291,689,972	1,255,145,752
未収配当金	1,583,281	2,505,399
流動資産合計	1,320,900,660	1,304,793,549
資産合計	1,320,900,660	1,304,793,549
負債の部		
流動負債		
未払解約金	394,000	2,779,000
流動負債合計	394,000	2,779,000
負債合計	394,000	2,779,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 753,612,190	740,519,917
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	566,894,470	561,494,632
元本等合計	1,320,506,660	1,302,014,549
純資産合計	1,320,506,660	1,302,014,549
負債純資産合計	1,320,900,660	1,304,793,549

### 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1月11日 至 2021年1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	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	772,639,327円	753,612,190円
期中追加設定元本額	87,407,995円	114,473,683円

期中一部解約元本額	106,435,132円	127,565,956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）	15,220,471円	14,138,671円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,253,942円	11,985,441円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	245,943,189円	222,883,258円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	41,888,141円	37,983,195円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	41,523,055円	39,060,634円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	64,007,562円	70,482,573円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	125,547,416円	129,181,575円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	206,228,414円	214,804,570円
計	753,612,190円	740,519,917円
2. 期末日における受益権の総数	753,612,190口	740,519,917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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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)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>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	77,848,112	96,172,228
合計	77,848,112	96,172,228

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年10月16日から2020年1月10日まで、及び2020年10月16日から2021年1月12日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2021年1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)

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7522円 (17,522円)	1.7582円 (17,582円)
---------------------------	----------------------	----------------------

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	UNILEVER PLC	3,752	44.160	165,688.320	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	14.205	210,859.020	
	AVIVA PLC	40,669	3.457	140,592.730	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	13.950	221,805.000	
	M&G PLC	68,765	1.965	135,157.600	
	TESCO PLC	71,252	2.444	174,139.880	
	VODAFONE GROUP PLC	135,523	1.283	173,876.000	
	NATIONAL GRID PLC	17,873	8.776	156,853.440	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	4.082	177,175.120	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	14.624	171,992.860		
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,728,139.970 (243,564,047)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,313	312.850	410,772.050	
	NESTLE SA-REG	5,578	100.600	561,146.800	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	903	382.800	345,668.400	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	83.800	367,798.200	
GIVAUDAN-REG	108	3,741.000	404,028.000		
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 2,089,413.450 (244,649,421)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,486	187.700	466,622.200	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 466,622.200 (5,860,775)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	

SIEMENS AG-REG	2,800	123.980	347,144.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	69.300	207,622.800	
BASF SE	3,676	67.550	248,313.800	
ALLIANZ SE-REG	1,145	203.300	232,778.500	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	240.500	297,979.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	15.190	321,192.550	
DEUTSCHE POST AG-REG	6,823	40.950	279,401.850	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	7,785	45.060	350,792.100	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	23.490	152,825.940	
KONINKLIJKE DSM NV	2,261	143.500	324,453.500	
KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.659	233,803.210	
TOTAL SE	6,299	36.915	232,527.580	
MICHELIN (CGDE)	2,155	107.250	231,123.750	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,443	126.800	563,372.400	
BNP PARIBAS	3,990	44.980	179,470.200	
CAPGEMINI SE	1,883	123.300	232,173.900	
AXA SA	12,126	20.250	245,551.500	
SANOFI	3,893	79.240	308,481.320	
INTESA SANPAOLO	100,555	1.942	195,358.250	
ENI SPA	12,935	8.978	116,130.430	
ENEL SPA	48,153	8.948	430,873.040	
ENAGAS SA	10,115	18.150	183,587.250	
NOKIA OYJ	28,771	3.145	90,499.180	
ユーロ 小計			ユーロ 6,005,456.550 (761,071,509)	
合計			1,255,145,752 [1,255,145,752]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 10銘柄	100%	19.4%

スイス・フラン	株式	5銘柄	100%	19.5%
スウェーデン・クローナ	株式	1銘柄	100%	0.5%
ユーロ	株式	23銘柄	100%	60.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,890,871	22,424,990
コール・ローン	3,982,785	4,324,649
株式	739,815,433	698,888,104
投資証券	7,810,464	-
派生商品評価勘定	-	15,604
未収入金	-	39,306,245
未収配当金	2,014,119	712,842
流動資産合計	772,513,672	765,672,434
資産合計	772,513,672	765,672,434
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	23,820
未払解約金	2,533,000	3,014,000
流動負債合計	2,533,000	3,037,820
負債合計	2,533,000	3,037,820
純資産の部		
元本等		
元本	1	365,560,068
剰余金		281,837,347



期末剰余金又は期末欠損金（ ）	404,420,604	480,797,267
元本等合計	769,980,672	762,634,614
純資産合計	769,980,672	762,634,614
負債純資産合計	772,513,672	765,672,434

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 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。 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

3. 収益及び費用の計上基準	<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>受取配当金</p> <p>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>
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1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	399,914,948円	365,560,068円
期中追加設定元本額	29,964,452円	13,237,838円
期中一部解約元本額	64,319,332円	96,960,559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）	12,675,264円	9,692,362円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,045,001円	8,198,991円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	207,648,885円	157,435,181円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	35,324,845円	26,377,648円

ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	35,358,128円	26,668,165円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	10,299,043円	9,134,583円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	20,069,686円	16,756,169円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	33,139,216円	27,574,248円
計	365,560,068円	281,837,347円
2. 期末日における受益権の総数	365,560,068口	281,837,347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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	43,867,826	121,599,871
投資証券	57,430	-
合計	43,925,256	121,599,871

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年10月16日から2020年1月10日まで、及び2020年10月16日から2021年1月12日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2021年1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)

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1063円 (21,063円)	2.7059円 (27,059円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP GROUP LTD	10,200	46.500	474,300.000	
	SOUTH32 LTD	40,900	2.600	106,340.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	6,300	25.460	160,398.000	

	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,200	25.210	105,882.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	12,700	23.210	294,767.000	
	WESTPAC BANKING CORP	12,100	20.290	245,509.000	
	RIO TINTO LTD	700	122.400	85,680.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,750	85.160	319,350.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,000	140.010	280,020.000	
	CSL LTD	600	275.950	165,570.000	
	WESFARMERS LTD	5,300	51.390	272,367.000	
	JB HI-FI LTD	1,700	49.760	84,592.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル	
				2,594,775.000	
				(208,464,223)	
オフショア・人民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	260	2,099.730	545,929.800	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元	
				545,929.800	
				(8,789,469)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	6,500	26.920	174,980.000	
	VENTURE CORP LTD	4,000	20.110	80,440.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	39,100	5.040	197,064.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル	
				452,484.000	
				(35,456,646)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SK HYNIX INC	2,200	133,000.000	292,600,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	500	267,500.000	133,750,000.000	
	POSCO	200	284,000.000	56,800,000.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	700	115,000.000	80,500,000.000	
	HYUNDAI MOBIS CO LTD	300	352,500.000	105,750,000.000	
	KT&G CORP	800	81,900.000	65,520,000.000	
	NAVER CORP	450	309,000.000	139,050,000.000	
	KIWOOM SECURITIES CO LTD	500	162,000.000	81,000,000.000	
	LG CHEM LTD	160	998,000.000	159,680,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	5,300	45,900.000	243,270,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,100	91,000.000	737,100,000.000	

	HANA FINANCIAL GROUP	4,100	37,700.000	154,570,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,400	56,800.000	79,520,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 2,329,110,000.000 (221,265,450)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,700	450.200	1,665,740.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	82,000	6.060	496,920.000	
	AIA GROUP LTD	15,400	98.850	1,522,290.000	
	CHINA RESOURCES CEMENT	42,000	9.390	394,380.000	
	SANDS CHINA LTD	26,000	32.000	832,000.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	28,000	16.740	468,720.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 5,380,050.000 (72,307,872)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MEDIATEK INC	10,000	851.000	8,510,000.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	85,000	30.050	2,554,250.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	141,000	19.950	2,812,950.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	11,000	394.000	4,334,000.000	
	POYA INTERNATIONAL CO LTD	4,000	578.000	2,312,000.000	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,000	245.500	1,227,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	33,000	584.000	19,272,000.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 41,022,700.000 (152,604,444)	
合計				698,888,104 [698,888,104]	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	----------------

オーストラリア・ドル	株式	12銘柄	100%	29.8%
オフショア・人民元	株式	1銘柄	100%	1.3%
シンガポール・ドル	株式	3銘柄	100%	5.1%
韓国・ウォン	株式	13銘柄	100%	31.7%
香港・ドル	株式	6銘柄	100%	10.3%
台湾・ドル	株式	7銘柄	100%	21.8%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2021年1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	421,027,153	220,345,078
株式	17,061,261,230	15,882,391,960
未収入金	67,790,026	-
未収配当金	33,336,850	27,877,750
流動資産合計	17,583,415,259	16,130,614,788
資産合計	17,583,415,259	16,130,614,788
負債の部		
流動負債		
未払金	1,663,613	19,722,053
未払解約金	9,300,000	9,815,000
流動負債合計	10,963,613	29,537,053
負債合計	10,963,613	29,537,053
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,085,455,292
剰余金		5,432,945,076



期末剰余金又は期末欠損金( )	11,486,996,354	10,668,132,659
元本等合計	17,572,451,646	16,101,077,735
純資産合計	17,572,451,646	16,101,077,735
負債純資産合計	17,583,415,259	16,130,614,788

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2021年1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	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	6,925,910,602円	6,085,455,292円
期中追加設定元本額	434,496,244円	340,283,342円
期中一部解約元本額	1,274,951,554円	992,793,558円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信(季節点描)	4,371,717,264円	3,615,424,047円

ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	26,532,128円	25,061,574円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	27,851,210円	25,444,630円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	24,665,342円	22,276,776円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	444,487,092円	408,556,095円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	75,782,733円	68,236,074円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	75,973,500円	70,435,625円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	168,401,560円	203,970,079円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	329,593,808円	373,184,938円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	540,450,655円	620,355,238円
計	6,085,455,292円	5,432,945,076円
2. 期末日における受益権の総数	6,085,455,292口	5,432,945,076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1月11日 至 2021年1月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年1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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	1,442,011,179	2,117,078,397
合計	1,442,011,179	2,117,078,397

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年10月16日から2020年1月10日まで、及び2020年10月16日から2021年1月12日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2021年1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)

	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1口当たり純資産額	2.8876円	2.9636円
(1万口当たり純資産額)	(28,876円)	(29,636円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ミライト・ホールディングス	15,000	1,769.00	26,535,000	
国際石油開発帝石	75,000	618.00	46,350,000	
熊谷組	30,000	2,693.00	80,790,000	
五洋建設	135,000	930.00	125,550,000	
住友林業	39,200	2,167.00	84,946,400	
大和ハウス	35,700	3,094.00	110,455,800	
協和エクシオ	28,000	2,894.00	81,032,000	
日本工営	7,900	2,835.00	22,396,500	
九電工	31,000	3,300.00	102,300,000	
ブルボン	23,200	2,062.00	47,838,400	
日鉄ソリューションズ	17,500	3,220.00	56,350,000	
ディップ	33,700	2,654.00	89,439,800	
エレマテック	22,800	1,051.00	23,962,800	
パルグループHLDGS	68,600	1,205.00	82,663,000	
太陽化学	23,000	1,768.00	40,664,000	
日本たばこ産業	66,800	2,048.00	136,806,400	
アルコニックス	66,300	1,487.00	98,588,100	
あいホールディングス	23,800	2,044.00	48,647,200	
東洋紡	32,100	1,411.00	45,293,100	
富士紡ホールディングス	16,700	3,970.00	66,299,000	
ダイワボウHD	13,500	9,540.00	128,790,000	
レスターホールディングス	11,700	2,326.00	27,214,200	
TOKAIホールディングス	194,700	1,024.00	199,372,800	
三洋貿易	149,200	1,006.00	150,095,200	
旭化成	192,900	1,139.00	219,713,100	
川田テクノロジーズ	13,400	4,295.00	57,553,000	
信和	55,800	700.00	39,060,000	
ハウスドゥ	49,300	1,210.00	59,653,000	
コメダホールディングス	32,800	1,856.00	60,876,800	
共和レザー	67,900	658.00	44,678,200	
セーレン	42,300	1,640.00	69,372,000	
SRAホールディングス	7,800	2,606.00	20,326,800	
クレハ	15,000	7,100.00	106,500,000	
日本曹達	32,000	3,145.00	100,640,000	
大阪ソーダ	22,300	2,760.00	61,548,000	

信越化学	9,300	19,645.00	182,698,500	
四国化成	46,900	1,243.00	58,296,700	
三菱瓦斯化学	52,800	2,384.00	125,875,200	
東京応化工業	11,500	7,780.00	89,470,000	
旭有機材	58,400	1,543.00	90,111,200	
リケンテクノス	52,400	487.00	25,518,800	
ダイキアクシス	28,500	1,181.00	33,658,500	
第一工業製薬	49,500	4,405.00	218,047,500	
三洋化成	6,200	5,630.00	34,906,000	
武田薬品	110,000	3,815.00	419,650,000	
大塚ホールディングス	50,000	4,402.00	220,100,000	
太陽ホールディングス	11,000	6,260.00	68,860,000	
日本空調サービス	78,700	761.00	59,890,700	
伊藤忠テクノソリュー	12,300	3,695.00	45,448,500	
富士フイルムHLDGS	43,200	6,022.00	260,150,400	
デクセリアルズ	151,200	1,360.00	205,632,000	
TOYO TIRE	29,500	1,610.00	47,495,000	
AGC	66,600	3,720.00	247,752,000	
日本特殊陶業	32,600	1,865.00	60,799,000	
ニチアス	53,500	2,510.00	134,285,000	
日本冶金工	25,100	1,811.00	45,456,100	
大紀アルミニウム	53,700	794.00	42,637,800	
三井金属	39,300	4,045.00	158,968,500	
住友鉱山	27,500	5,037.00	138,517,500	
アサヒHD	23,600	3,940.00	92,984,000	
OSJBHD	310,400	281.00	87,222,400	
三和ホールディングス	96,500	1,223.00	118,019,500	
日東精工	121,700	453.00	55,130,100	
マルゼン	32,600	1,835.00	59,821,000	
ファインシンター	19,500	1,521.00	29,659,500	
タクマ	58,900	2,100.00	123,690,000	
テクノプロ・ホールディング	8,700	9,130.00	79,431,000	
DMG森精機	30,000	1,669.00	50,070,000	
ソディック	68,700	911.00	62,585,700	
ベルシステム24HLDGS	65,700	1,721.00	113,069,700	
豊田自動織機	13,900	8,460.00	117,594,000	
技研製作所	21,200	4,270.00	90,524,000	
クボタ	46,900	2,286.00	107,213,400	
荏原実業	11,700	4,085.00	47,794,500	
三精テクノロジーズ	30,000	598.00	17,940,000	

ダイフク	11,000	13,360.00	146,960,000
キトー	59,700	1,557.00	92,952,900
日本トムソン	138,800	430.00	59,684,000
日立	88,500	4,352.00	385,152,000
富士電機	58,000	4,185.00	242,730,000
マブチモーター	22,400	4,305.00	96,432,000
愛知電機	20,000	2,501.00	50,020,000
E I Z O	13,300	3,610.00	48,013,000
T D K	11,500	16,400.00	188,600,000
アドバンテスト	33,900	8,260.00	280,014,000
デンソー	25,400	6,065.00	154,051,000
村田製作所	24,000	10,110.00	242,640,000
I H I	79,900	2,062.00	164,753,800
プレミアグループ	85,600	2,557.00	218,879,200
トヨタ自動車	52,200	7,892.00	411,962,400
ミクニ	69,700	273.00	19,028,100
本田技研	77,600	2,888.00	224,108,800
萩原電気H L D G S	18,200	2,621.00	47,702,200
コジマ	81,100	693.00	56,202,300
アルゴグラフィックス	29,500	3,055.00	90,122,500
ダイトロン	57,100	1,625.00	92,787,500
ナカニシ	15,300	2,152.00	32,925,600
スター精密	42,500	1,608.00	68,340,000
リコー	111,800	700.00	78,260,000
トランザクション	37,800	957.00	36,174,600
フジシールインターナショナル	52,100	2,019.00	105,189,900
大日本印刷	67,900	1,891.00	128,398,900
藤森工業	10,600	4,800.00	50,880,000
リンテック	23,600	2,364.00	55,790,400
信越ポリマー	130,400	966.00	125,966,400
任天堂	2,300	66,550.00	153,065,000
伊藤忠	72,700	3,106.00	225,806,200
三井物産	119,000	1,960.00	233,240,000
東京エレクトロン	7,800	40,800.00	318,240,000
スターゼン	10,800	4,310.00	46,548,000
セイコーHD	41,000	1,376.00	56,416,000
日本ユニシス	12,000	4,095.00	49,140,000
稲畑産業	43,000	1,461.00	62,823,000
三菱UFJフィナンシャルG	664,700	494.30	328,561,210
りそなホールディングス	150,000	388.00	58,200,000

三井住友トラストHD	45,100	3,328.00	150,092,800	
三井住友フィナンシャルG	99,000	3,480.00	344,520,000	
セブン銀行	151,800	227.00	34,458,600	
SBIホールディングス	65,000	2,675.00	173,875,000	
オリックス	135,000	1,836.50	247,927,500	
SOMPOホールディングス	20,000	4,260.00	85,200,000	
MS&AD	55,000	3,265.00	179,575,000	
第一生命HLDGS	40,000	1,775.00	71,000,000	
東京海上HD	69,600	5,573.00	387,880,800	
三井不動産	17,500	2,074.50	36,303,750	
東京建物	85,000	1,481.00	125,885,000	
丸全昭和運輸	14,600	3,615.00	52,779,000	
センコーグループHLDGS	110,100	1,014.00	111,641,400	
三井倉庫HOLD	57,600	2,346.00	135,129,600	
日本電信電話	132,000	2,745.00	362,340,000	
KDDI	95,000	3,206.00	304,570,000	
ソフトバンク	149,200	1,352.50	201,793,000	
シーイーシー	29,000	1,519.00	44,051,000	
日本管財	10,400	2,075.00	21,580,000	
丹青社	35,700	814.00	29,059,800	
コナミホールディングス	18,200	6,110.00	111,202,000	
日鉄物産	29,500	3,915.00	115,492,500	
合計			15,882,391,960	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2020年1月11日から2021年1月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,872,196	96,603,304
親投資信託受益証券	5,731,930,567	6,428,508,091
未収入金	9,212,000	575,000
流動資産合計	5,827,014,763	6,525,686,395
資産合計	5,827,014,763	6,525,686,395
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,577,399	5,017,259
未払受託者報酬	1,465,395	1,695,859
未払委託者報酬	29,308,638	33,918,272
その他未払費用	221,428	254,288
流動負債合計	43,572,860	40,885,678
負債合計	43,572,860	40,885,678
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,061,995,528	1 3,443,846,915
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,721,446,375	3,040,953,802
（分配準備積立金）	1,028,078,333	951,666,768
元本等合計	5,783,441,903	6,484,800,717
純資産合計	5,783,441,903	6,484,800,717
負債純資産合計	5,827,014,763	6,525,686,395

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期 自 2019年1月11日 至 2020年1月10日	第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	129	311
有価証券売買等損益	730,980,594	95,491,524
その他収益	5,361	-
<b>営業収益合計</b>	<b>730,986,084</b>	<b>95,491,835</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	35,267	26,904
受託者報酬	2,716,605	3,184,549
委託者報酬	1 54,333,478	1 63,692,775
その他費用	409,776	478,137
<b>営業費用合計</b>	<b>57,495,126</b>	<b>67,382,365</b>
<b>営業利益</b>	<b>673,490,958</b>	<b>28,109,470</b>
<b>経常利益</b>	<b>673,490,958</b>	<b>28,109,470</b>
<b>当期純利益</b>	<b>673,490,958</b>	<b>28,109,470</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	50,746,440	73,034,928
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,685,012,509	2,721,446,375
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>676,574,204</b>	<b>754,703,067</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	676,574,204	754,703,067
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>262,884,856</b>	<b>536,340,038</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	262,884,856	536,340,038
<b>分配金</b>	<b>2 -</b>	<b>2 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>2,721,446,375</b>	<b>3,040,953,802</b>

## (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15期	
	自 2020年1月11日	至 2021年1月12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  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年1月12日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首元本額	2,605,579,705円	3,061,995,528円
期中追加設定元本額	853,612,726円	998,812,762円
期中一部解約元本額	397,196,903円	616,961,375円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,061,995,528口	3,443,846,915口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 2019年1月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	8,082,436円	9,376,726円

2. 2 分配金の計算過程	<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(404,567,791円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,948,433,334円)及び分配準備積立金(623,510,542円)より分配可能額は2,976,511,667円(1万口当たり9,720.82円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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(101,146,091円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,497,179,344円)及び分配準備積立金(850,520,677円)より分配可能額は3,448,846,112円(1万口当たり10,014.52円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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	<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、金利変動等)、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	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	第15期 2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12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	704,590,562	109,230,552
合計	704,590,562	109,230,552

## （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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8888円 (18,888円)	1.8830円 (18,830円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	外国債券インデックスマザーファンド	348,917,972	1,054,709,245	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	815,724,660	1,052,692,673	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	396,866,111	1,046,456,561	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	373,184,938	1,105,970,882	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	242,195,048	821,186,529	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	129,181,575	227,127,045	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	16,756,169	45,340,517	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	365,816,395	1,075,024,639	
親投資信託受益証券 合計			6,428,508,091	
合計			6,428,508,091	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2020年1月11日から2021年1月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	100,922,205	109,605,453
親投資信託受益証券	6,271,243,299	7,175,520,706
未収入金	6,870,000	11,120,000
流動資産合計	6,379,035,504	7,296,246,159
資産合計	6,379,035,504	7,296,246,159
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,914,310	14,385,268
未払受託者報酬	1,603,359	1,831,327
未払委託者報酬	36,878,037	42,121,458
その他未払費用	242,271	274,613
流動負債合計	51,637,977	58,612,666
負債合計	51,637,977	58,612,666
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,104,040,281	1 3,580,161,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,223,357,246	3,657,471,538
（分配準備積立金）	1,268,061,314	1,208,632,750
元本等合計	6,327,397,527	7,237,633,493
純資産合計	6,327,397,527	7,237,633,493
負債純資産合計	6,379,035,504	7,296,246,159

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期 自 2019年1月11日 至 2020年1月10日	第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	112	342
有価証券売買等損益	974,384,171	121,247,407
その他収益	11,239	-
<b>営業収益合計</b>	<b>974,395,522</b>	<b>121,247,749</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	39,244	29,619
受託者報酬	2,931,282	3,402,323
委託者報酬	1 67,421,319	1 78,255,738
その他費用	442,202	510,883
<b>営業費用合計</b>	<b>70,834,047</b>	<b>82,198,563</b>
<b>営業利益</b>	<b>903,561,475</b>	<b>39,049,186</b>
<b>経常利益</b>	<b>903,561,475</b>	<b>39,049,186</b>
<b>当期純利益</b>	<b>903,561,475</b>	<b>39,049,186</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	56,495,608	107,754,907
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,853,013,579	3,223,357,246
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>794,005,194</b>	<b>876,016,089</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	794,005,194	876,016,089
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>270,727,394</b>	<b>588,705,890</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	270,727,394	588,705,890
<b>分配金</b>	<b>2 -</b>	<b>2 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>3,223,357,246</b>	<b>3,657,471,538</b>

## (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15期	
	自 2020年1月11日	至 2021年1月12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  2021年1月10日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年1月12日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	2020年1月10日現在	2021年1月12日現在
1. 1 期首元本額	2,571,575,161円	3,104,040,281円
期中追加設定元本額	898,116,398円	1,060,242,411円
期中一部解約元本額	365,651,278円	584,120,737円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,104,040,281口	3,580,161,955口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 2019年1月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2021年1月12日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	11,738,990円	13,605,054円

2. 2 分配金の計算過程	<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(524,362,000円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,383,882,207円)及び分配準備積立金(743,699,314円)より分配可能額は3,651,943,521円(1万口当たり11,765.13円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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(146,809,745円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,150,285,577円)及び分配準備積立金(1,061,823,005円)より分配可能額は4,358,918,327円(1万口当たり12,175.20円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、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15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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、金利変動等)、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	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	第15期 2021年1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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12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	948,130,460	140,670,148
合計	948,130,460	140,670,148

## （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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 2020年1月11日 至 2021年1月12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14期 2020年1月10日現在	第15期 2021年1月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0384円 (20,384円)	2.0216円 (20,216円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	116,184,508	351,202,530	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	271,665,036	350,583,728	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	526,567,569	1,388,453,365	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	620,355,238	1,838,484,783	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	401,865,747	1,362,566,001	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	214,804,570	377,669,394	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	27,574,248	74,613,157	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	487,272,518	1,431,947,748	
親投資信託受益証券 合計			7,175,520,706	
合計			7,175,520,706	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「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/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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年7月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		94,412,296
親投資信託受益証券		6,831,599,736
未収入金		2,792,000
流動資産合計		6,928,804,032
<b>資産合計</b>		
6,928,804,032		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		4,655,252
未払受託者報酬		1,741,673
未払委託者報酬		29,609,015
その他未払費用		261,158
流動負債合計		36,267,098
<b>負債合計</b>		
36,267,098		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 3,514,451,676
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		3,378,085,258
(分配準備積立金)		747,640,482
元本等合計		6,892,536,934
<b>純資産合計</b>		
6,892,536,934		
<b>負債純資産合計</b>		
6,928,804,032		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
<b>営業収益</b>	
受取利息	2
有価証券売買等損益	680,216,004
営業収益合計	680,216,006
<b>営業費用</b>	
支払利息	8,033
受託者報酬	1,741,673
委託者報酬	1 29,609,015
その他費用	261,200
営業費用合計	31,619,921
営業利益又は営業損失( )	648,596,085
経常利益又は経常損失( )	648,596,085
中間純利益又は中間純損失( )	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( )	21,230,396
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,540,303,816
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	372,022,199
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	161,606,446
中間剰余金又は中間欠損金( )	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	至
	2021年1月13日	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	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	3,298,446,758円
期中追加設定元本額	424,560,202円
期中一部解約元本額	208,555,284円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	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	当中間計算期間	
	自	至
	2021年1月13日	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	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

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。

（1口当たり情報）

	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)	1.9612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7月12日現在 金額（円）
--	-----------------------

資産の部	
流動資産	
預金	565,453,319
コール・ローン	579,915,192
国債証券	223,953,312,956
未収利息	1,265,540,246
前払費用	22,835,627
流動資産合計	226,387,057,340
資産合計	226,387,057,340
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,896,260
未払金	1,951,870
未払解約金	204,048,427
その他未払費用	5,940
流動負債合計	208,902,497
負債合計	208,902,497
純資産の部	
元本等	
元本	1 72,559,196,854
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	153,618,957,989
元本等合計	226,178,154,843
純資産合計	226,178,154,843
負債純資産合計	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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	70,827,785,140円
期中追加設定元本額	5,100,799,436円
期中一部解約元本額	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	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)	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)	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)	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)	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)	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)	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)	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)	816,714,483円
D-I's 外国債券インデッ クス	973,369円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,206,442円
iFree 外国債券イン デックス	1,331,422,461円
iFree 8資産バランス	1,288,379,174円
iFree 年金バランス	168,670,927円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,280,771,026円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	897,056,433円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	537,452,629円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	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)	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)	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)	147,341,792円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	25,244,169円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,365,036円
ダイワつみたてインデックス外国債券	357,811,537円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,251,349円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,182,039円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,559,838円
ダイワ世界バランスファンド40VA	172,997,093円
ダイワ世界バランスファンド60VA	137,923,081円
ダイワ・バランスファンド35VA	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)	244,906,590円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,305,683円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	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)	1,884,612,572円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,827,609,550円
ダイワライフスタイル25	33,269,210円
ダイワライフスタイル50	64,319,037円
ダイワライフスタイル75	17,308,590円
計	72,559,196,854円

2. 期末日における受益権の総数

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7月12日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	383,023,336	-	380,127,076	2,896,260
アメリカ・ドル	210,946,059	-	209,379,181	1,566,878
ユーロ	172,077,277	-	170,747,895	1,329,382
合計	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7月12日現在
1口当たり純資産額	3.1172円
(1万口当たり純資産額)	(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7月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	144,903,887
国債証券	28,427,155,080
地方債証券	1,776,574,200
特殊債券	731,041,900
社債券	928,386,200
未収利息	43,302,129
前払費用	1,717,532
流動資産合計	32,053,080,928
資産合計	32,053,080,928
負債の部	

流動負債		
未払解約金		4,651,014
流動負債合計		4,651,014
負債合計		4,651,014
純資産の部		
元本等		
元本	1	24,773,940,277
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,274,489,637
元本等合計		32,048,429,914
純資産合計		32,048,429,914
負債純資産合計		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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	19,879,992,868円
期中追加設定元本額	5,041,293,956円
期中一部解約元本額	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）	559,310,369円
i F r e e 日本債券イン デックス	2,603,155,025円
i F r e e 8資産バランス ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,104,329,794円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	7,924,393,523円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	5,176,127,109円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/安定コース）	1,649,806,006円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/6分散コー ス）	1,315,612,785円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽/成長コース）	990,971,569円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	356,034,569円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	549,617,154円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	28,836,524円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	11,403,640円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	7,545,417円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	297,536,014円
計	199,260,779円
2. 期末日における受益権の総数	24,773,940,277円
	24,773,940,277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)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

2021年7月12日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	1.2936円
（1万口当たり純資産額）	(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7月12日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,525,179,686
コール・ローン	673,035,017
投資証券	82,471,598,365
派生商品評価勘定	1,935
未収入金	579,287,318
未収配当金	324,727,359
流動資産合計	88,573,829,680
資産合計	88,573,829,680
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	382

未払金		611,219,056
未払解約金		30,196,000
その他未払費用		5,940
流動負債合計		641,421,378
負債合計		641,421,378
純資産の部		
元本等		
元本	1	26,045,395,597
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		61,887,012,705
元本等合計		87,932,408,302
純資産合計		87,932,408,302
負債純資産合計		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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</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>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> <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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	28,120,093,755円
期中追加設定元本額	152,842,404円
期中一部解約元本額	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REIT・オープン（毎月分配型）	22,735,826,193円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	25,537,755円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,271,549円



インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	9,150,085円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	48,701,652円
6資産バランスファンド(分 配型)	92,711,424円
6資産バランスファンド(成 長型)	257,147,248円
りそな ワールド・リート・ ファンド	1,138,572,214円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	26,643,176円
常陽3分法ファンド	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)	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)	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)	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)	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)	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)	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)	23,860,786円
計	26,045,395,597円
2. 期末日における受益権の総数	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	(1)有価証券

	<p>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7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	11,172,854	-	11,172,722	132
アメリカ・ドル	11,172,854	-	11,172,722	132
買 建	11,172,854	-	11,174,275	1,421
シンガポール・ドル	8,211,215	-	8,213,018	1,803
ユーロ	2,961,639	-	2,961,257	382
合計	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7月12日現在
1口当たり純資産額	3.3761円
(1万口当たり純資産額)	(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7月12日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,761,350,315	
投資証券	2	120,902,983,000
派生商品評価勘定	84,108,000	
未収入金	886,464,173	
未収配当金	578,266,790	
流動資産合計	125,213,172,278	
資産合計	125,213,172,278	
負債の部		
流動負債		
前受金	75,840,000	
未払金	1,428,518,312	
未払解約金	21,443,000	
流動負債合計	1,525,801,312	
負債合計	1,525,801,312	
純資産の部		
元本等		

元本	1	33,726,813,509
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		89,960,557,457
元本等合計		123,687,370,966
純資産合計		123,687,370,966
負債純資産合計		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	<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、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	32,599,135,387円
期中追加設定元本額	2,668,515,865円

期中一部解約元本額	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 )	31,056,616,872円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	9,344,842円
インカム重視ポートフォリオ ( 奇数月分配型 )	8,597,779円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	44,489,726円
6資産バランスファンド(分 配型)	86,212,679円
6資産バランスファンド(成 長型)	232,909,612円
世界6資産均等分散ファンド ( 毎月分配型 )	24,816,935円
ダイワ資産分散インカムオー プン( 奇数月決算型 )	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)	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)	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)	508,100,729円
DCダイワJ - R E I Tアク ティブファンド	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)	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)	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)	103,879,165円
ダイワ・アクティブJリー ト・ファンド(年4回決算 型)	590,426,630円

計		33,726,813,509円
2. 期末日における受益権の総数		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す。	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7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	2,511,960,000	-	2,596,200,000	84,240,000
合計	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7月12日現在
1口当たり純資産額	3.6673円
(1万口当たり純資産額)	(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7月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	76,826,670
コール・ローン	88,599,132
株式	2,969,082,916
ハイブリッド優先証券	667,057,714
投資証券	19,525,064
未収配当金	2,390,139
未収利息	977,968
流動資産合計	3,824,459,603
資産合計	3,824,459,603
負債の部	
流動負債	
未払金	19,220,702
未払解約金	4,440,000
その他未払費用	5,940

流動負債合計		23,666,642
負債合計		23,666,642
純資産の部		
元本等		
元本	1	935,810,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,864,982,475
元本等合計		3,800,792,961
純資産合計		3,800,792,961
負債純資産合計		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	<p>(1)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)ハイブリッド優先証券</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>(3)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>
<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>(1)受取配当金</p> <p>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</p> <p>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>
<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>

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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	946,303,989円
期中追加設定元本額	45,227,273円
期中一部解約元本額	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)	5,503,707円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	5,041,612円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	93,802,182円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	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)	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)	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)	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)	431,679,115円
計	935,810,486円
2. 期末日における受益権の総数	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7月12日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	4.0615円
（1万口当たり純資産額）	（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7月12日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	18,993,106
コール・ローン	44,106,527
株式	1,352,865,419
未収配当金	1,478,701
流動資産合計	1,417,443,753
資産合計	1,417,443,753
負債の部	

流動負債		
未払解約金		1,342,000
その他未払費用		5,940
流動負債合計		1,347,940
負債合計		1,347,940
純資産の部		
元本等		
元本	1	700,196,682
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		715,899,131
元本等合計		1,416,095,813
純資産合計		1,416,095,813
負債純資産合計		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  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

	<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、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> <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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	740,519,917円
期中追加設定元本額	31,651,008円
期中一部解約元本額	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）	10,935,306円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,880,281円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	186,900,415円

ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	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)	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)	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)	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)	232,487,715円
計	700,196,682円
2. 期末日における受益権の総数	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7月12日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.0224円
(1万口当たり純資産額)	(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7月12日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		23,675,435
コール・ローン		2,233,425
株式		665,502,364
未収入金		377,136
未収配当金		1,766,886
流動資産合計		693,555,246
資産合計		693,555,246
負債の部		
流動負債		
未払解約金		435,000
その他未払費用		5,940
流動負債合計		440,940
負債合計		440,940
純資産の部		
元本等		
元本	1	242,537,291
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		450,577,015
元本等合計		693,114,306
純資産合計		693,114,306
負債純資産合計		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	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>
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> <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7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日



期首元本額	281,837,347円
期中追加設定元本額	9,436,080円
期中一部解約元本額	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)	7,877,295円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	6,771,731円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	129,942,826円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	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)	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)	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)	16,336,821円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	29,565,353円
計	242,537,291円
2. 期末日における受益権の総数	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

2021年7月12日 現在

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.8578円
(1万口当たり純資産額)	(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7月12日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	270,809,152	
株式	15,623,046,240	
未収入金	136,916,454	
未収配当金	22,149,350	
流動資産合計	16,052,921,196	
資産合計	16,052,921,196	
負債の部		
流動負債		
未払金	40,341,166	
未払解約金	7,260,000	
流動負債合計	47,601,166	
負債合計	47,601,166	
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,826,647,209
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,178,672,821	
元本等合計	16,005,320,030	
純資産合計	16,005,320,030	

負債純資産合計	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	<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。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. 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、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年7月12日現在
1. 1 期首	2021年1月13日
期首元本額	5,432,945,076円
期中追加設定元本額	181,427,916円
期中一部解約元本額	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（季節点描）	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）	24,095,543円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	20,952,963円

インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	18,741,924円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	345,252,770円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	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)	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)	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)	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)	692,436,881円
計	4,826,647,209円
2. 期末日における受益権の総数	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7月12日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額	3.3160円
(1万口当たり純資産額)	(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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年7月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		111,518,126
親投資信託受益証券		7,721,391,863
未収入金		6,754,000
流動資産合計		7,839,663,989
<b>資産合計</b>		
7,839,663,989		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		8,416,550
未払受託者報酬		1,947,139
未払委託者報酬		38,943,488
その他未払費用		291,982
流動負債合計		49,599,159
<b>負債合計</b>		
49,599,159		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 3,652,255,656
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		4,137,809,174
(分配準備積立金)		890,271,972
元本等合計		7,790,064,830
<b>純資産合計</b>		
7,790,064,830		
<b>負債純資産合計</b>		
7,839,663,989		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
<b>営業収益</b>	
受取利息	3
有価証券売買等損益	920,911,772
営業収益合計	920,911,775
<b>営業費用</b>	
支払利息	9,334
受託者報酬	1,947,139
委託者報酬	1 38,943,488
その他費用	292,029
営業費用合計	41,191,990
営業利益又は営業損失( )	879,719,785
経常利益又は経常損失( )	879,719,785
中間純利益又は中間純損失( )	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( )	28,927,165
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,040,953,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	454,821,444
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	208,758,692
中間剰余金又は中間欠損金( )	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	至
	2021年1月13日	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	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	3,443,846,915円
期中追加設定元本額	443,426,805円
期中一部解約元本額	235,018,064円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	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	当中間計算期間	
	自	至
	2021年1月13日	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	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

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。

（1口当たり情報）

	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)	2.1329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。

## 1【中間財務諸表】

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2021年7月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		139,423,645
親投資信託受益証券		9,246,740,768
未収入金		7,888,000
流動資産合計		9,394,052,413
<b>資産合計</b>		
9,394,052,413		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		10,997,770
未払受託者報酬		2,250,893
未払委託者報酬		51,771,719
その他未払費用		337,549
流動負債合計		65,357,931
<b>負債合計</b>		
65,357,931		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 3,940,052,758
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		5,388,641,724
（分配準備積立金）		1,140,318,535
元本等合計		9,328,694,482
<b>純資産合計</b>		
9,328,694,482		
<b>負債純資産合計</b>		
9,394,052,413		

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
<b>営業収益</b>	
受取利息	3
有価証券売買等損益	1,336,121,062
営業収益合計	1,336,121,065
<b>営業費用</b>	
支払利息	11,143
受託者報酬	2,250,893
委託者報酬	1,517,719
その他費用	337,605
営業費用合計	54,371,360
営業利益又は営業損失( )	1,281,749,705
経常利益又は経常損失( )	1,281,749,705
中間純利益又は中間純損失( )	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( )	38,537,940
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,657,471,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	710,994,727
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	223,036,306
中間剰余金又は中間欠損金( )	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	至
	2021年1月13日	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	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 1 期首元本額	3,580,161,955円
期中追加設定元本額	576,168,677円
期中一部解約元本額	216,277,874円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	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	当中間計算期間	
	自	至
	2021年1月13日	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	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

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。

（1口当たり情報）

	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）	2.3677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」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「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。

## 2【ファンドの現況】

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

## 【純資産額計算書】

2021年7月30日

資産総額	6,953,778,111円
負債総額	3,932,448円
純資産総額( - )	6,949,845,663円
発行済数量	3,547,430,438口
1単位当たり純資産額( / )	1.9591円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	228,537,037,475円
負債総額	76,318,834円
純資産総額( - )	228,460,718,641円
発行済数量	73,054,097,273口
1単位当たり純資産額( / )	3.1273円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	32,797,283,803円
負債総額	155,601,900円
純資産総額( - )	32,641,681,903円
発行済数量	25,180,382,447口
1単位当たり純資産額( / )	1.2963円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	90,300,478,159円
負債総額	409,881,937円
純資産総額（ - ）	89,890,596,222円
発行済数量	26,577,092,742口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.3823円

## (参考) ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	124,089,485,810円
負債総額	664,028,166円
純資産総額（ - ）	123,425,457,644円
発行済数量	33,787,986,477口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.6529円

## (参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	3,817,511,491円
負債総額	2,764,000円
純資産総額（ - ）	3,814,747,491円
発行済数量	940,892,355口
1 単位当たり純資産額（ / ）	4.0544円

## (参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	1,432,456,425円
負債総額	0円

純資産総額（ - ）	1,432,456,425円
発行済数量	708,594,446口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0215円

## (参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	699,864,444円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	699,864,444円
発行済数量	243,715,760口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.8716円

## (参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	15,656,850,327円
負債総額	63,321,057円
純資産総額（ - ）	15,593,529,270円
発行済数量	4,772,872,591口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.2671円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

## 純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	7,878,081,171円
負債総額	15,032,606円
純資産総額（ - ）	7,863,048,565円
発行済数量	3,696,268,273口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.1273円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

純資産額計算書

2021年7月30日

資産総額	9,405,306,110円
負債総額	9,590,207円
純資産総額( - )	9,395,715,903円
発行済数量	3,987,153,340口
1単位当たり純資産額( / )	2.3565円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて



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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

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。

##### 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【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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>流動資産計</b>	<b>36,088</b>	<b>37,539</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>	<b>1</b>	<b>1</b>
建物	7	6
器具備品	209	218
<b>無形固定資産</b>	<b>2,362</b>	<b>1,937</b>
ソフトウェア	2,028	1,882
ソフトウェア仮勘定	333	54
<b>投資その他の資産</b>	<b>15,844</b>	<b>16,121</b>
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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
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						
残余金の配当	-	-	-	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			
残余金の配当	-	-	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）其他有価証券

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ありません。

（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、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 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 (2021年03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	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	(注3)	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	株式会社りそな銀行	279,928百万円	(注6)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,9121-0 (2020年12月31日現在)		
	コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	535千米ドル (2020年12月31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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

### 第3【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
  - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
  - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
  - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
    - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
    - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 使用開始日を記載することがあります。
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
    - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
    - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
  - ・ 次の事項を記載することがあります。
    - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
    - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
    - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
  - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
  - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
  - ・ 図案を採用することがあります。
  - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
  - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
  - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

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2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 小林 英之 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2020年1月11日から2021年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2021年1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2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 小林 英之 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2020年1月11日から2021年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）の2021年1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2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 小林 英之 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2020年1月11日から2021年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2021年1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／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。