【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2021年11月9日提出
【計算期間】	第32特定期間 （自　2021年2月16日　至　2021年8月16日）
【ファンド名】	ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、海外の公社債および不動産投資信託証券ならびにわが国の株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と値上がり益の獲得により、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。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※属性区分に記載している「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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

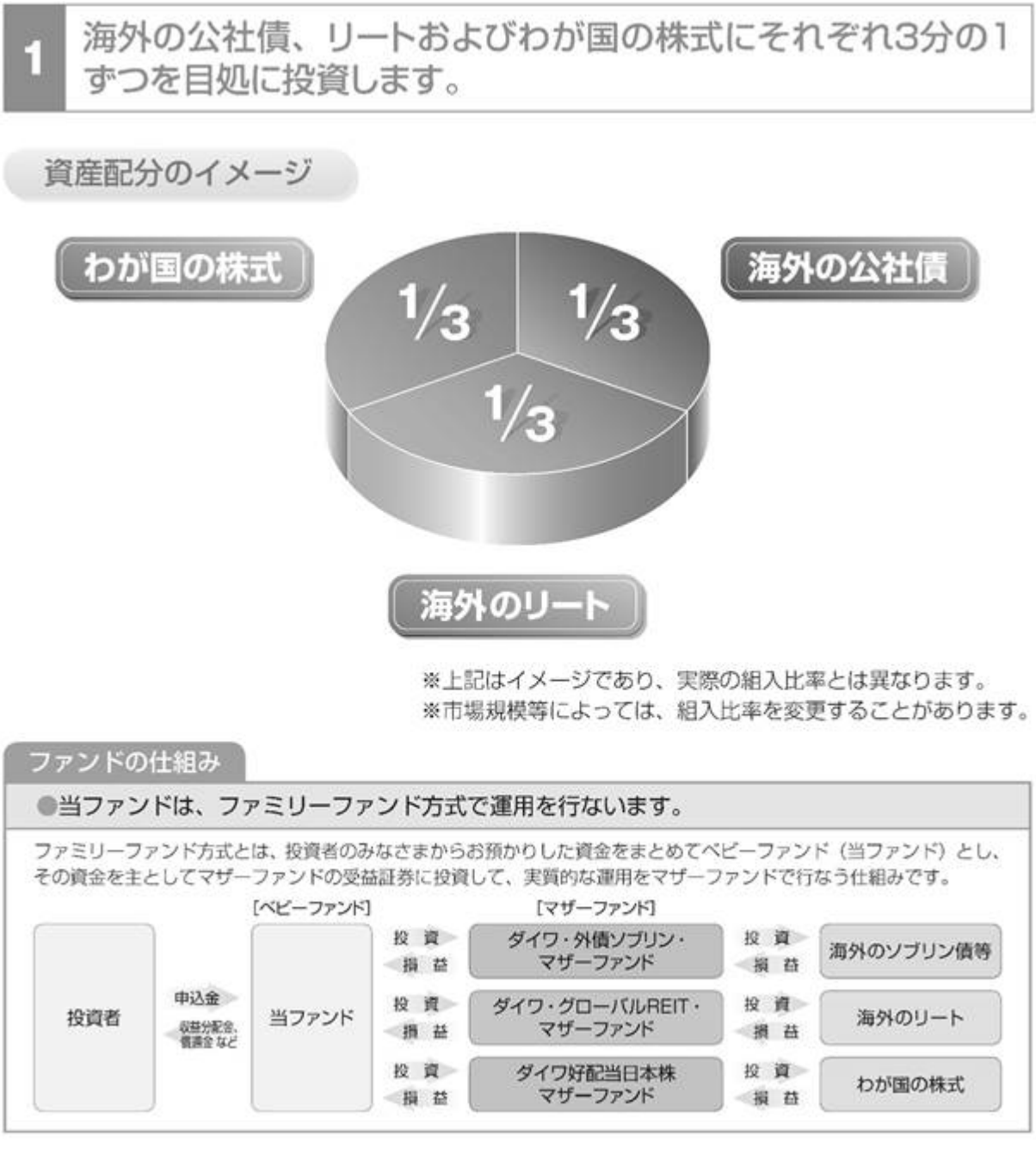
※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレスhttp://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億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＞



2 海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度　欧州通貨圏：50%程度

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

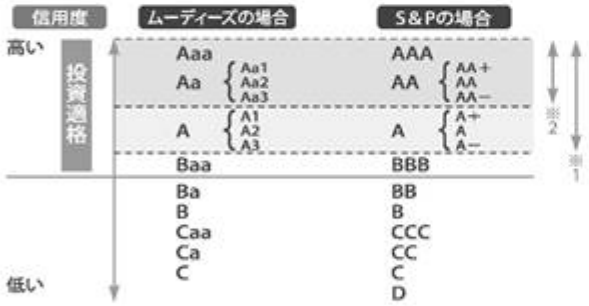
※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて



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

※1　ムーディーズでA3以上またはS&PでA−以上
※2　ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上

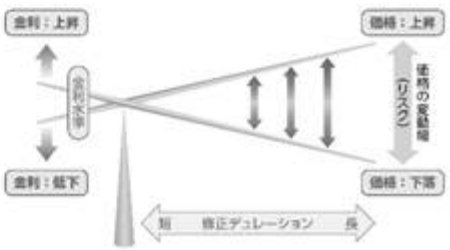
●ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

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

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

金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ）



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

3 海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。

●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。

投資対象地域 (イメージ)

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

〈 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて 〉

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

リートへの投資のイメージ

(注)リート=不動産投資信託(Real Estate Investment Trust, REIT)

●少額から投資でき、さまざまな不動産に分散が可能になります。
●専門家が不動産の選定を行ないます。
●上場しているリートは換金性に優れています。

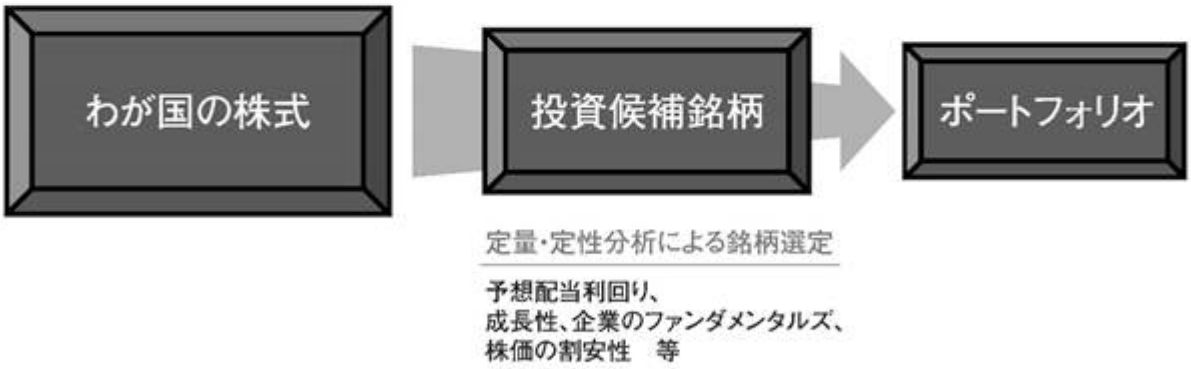
4 わが国の株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。

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。

配当利回り（%）＝（1株当たり年間配当金 ÷ 株価）×100

銘柄選定プロセス



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

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～4.の運用が行なわれないことがあります。

5 毎年2、5、8、11月の各15日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉
◆分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
◆原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
◆基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。
◆分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ

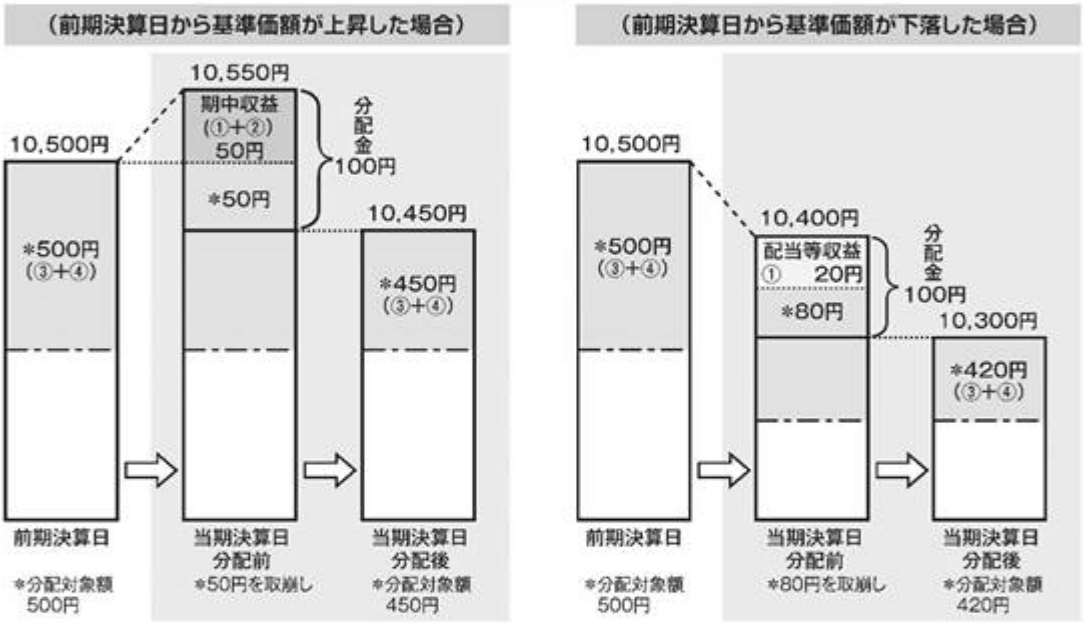
・上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
・分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
・ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

［収益分配金に関する留意事項］

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

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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

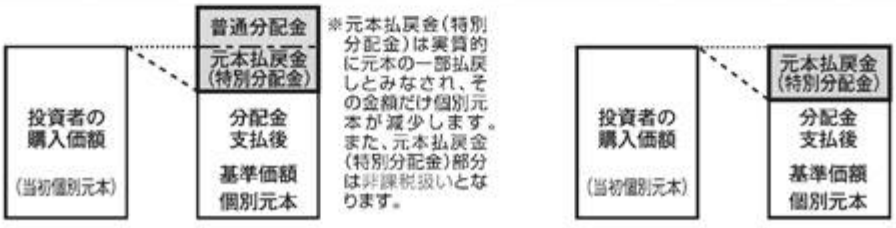


(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

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



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

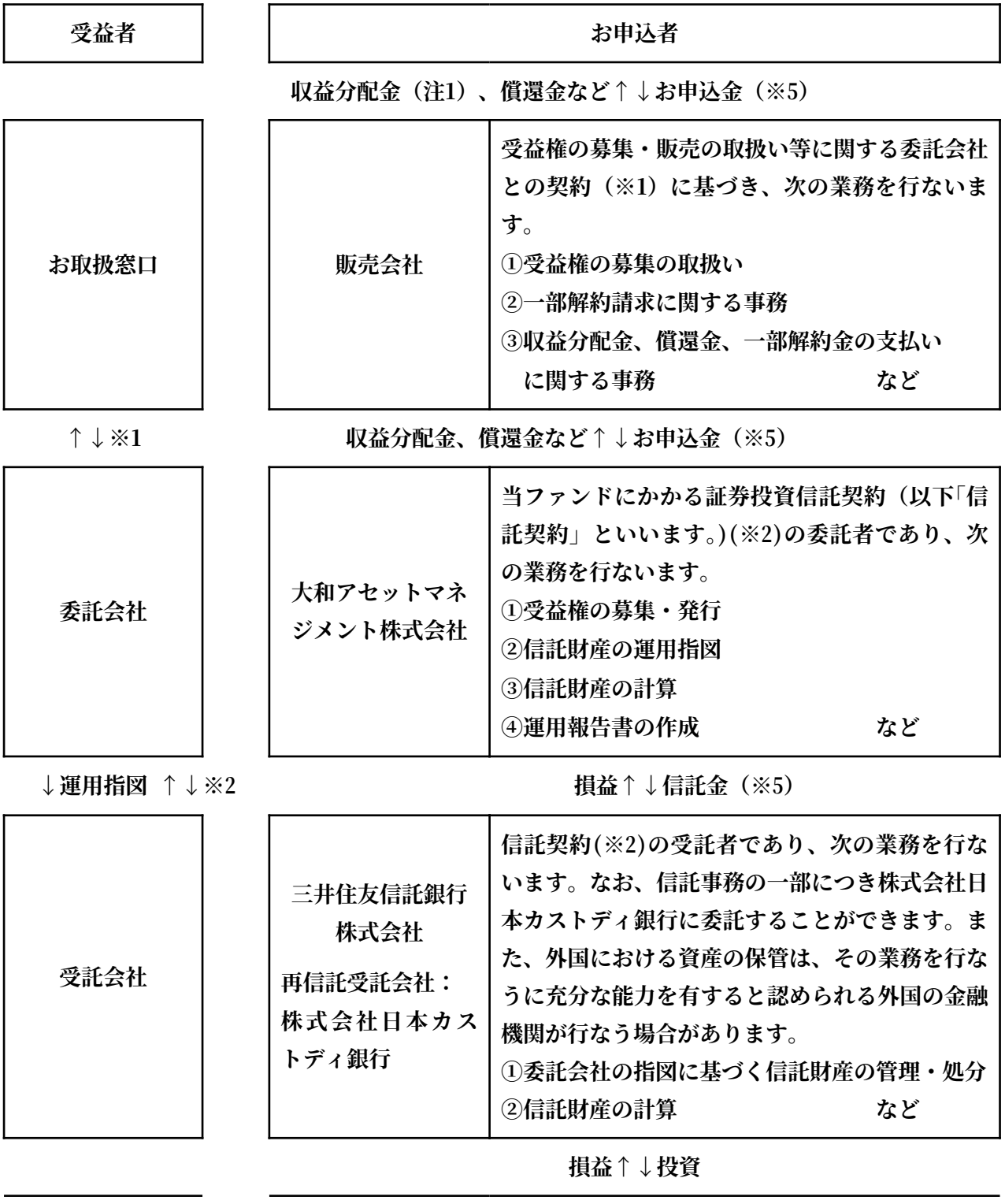
(注)普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

(2)【ファンドの沿革】

2005年10月3日	信託契約締結、当初自己設定、運用開始
2005年10月4日	ファンドの名称に（愛称：３つの恵み）を追加

2006年5月10日	・ファンドの名称を「ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）（愛称：３つの恵み）」に変更（従来は「ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）（毎月分配型）（愛称：３つの恵み）」） ・計算期間を毎年2月16日から5月15日まで、5月16日から8月15日まで、8月16日から11月15日まで、および11月16日から翌年2月15日までに変更（従来は毎月16日から翌月15日まで。ただし、第1計算期間は、2005年10月3日から2005年11月15日まで。）

(3)【ファンドの仕組み】



投資対象	海外の公社債および不動産投資信託証券ならびにわが国の株式 など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。なお、ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク（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。）

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。
（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（※3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、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の指図を行ないます（※4）。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
※4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
※5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社の概況（2021年8月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、各マザーファンドの受益証券を通じて海外の公社債および不動産投資信託証券ならびにわが国の株式に投資を行ない、主に海外資産運用による安定的な配当等収益の確保に加え投資対象資産の値上がり益の獲得により、信託財産の中長期的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を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

…信託財産の純資産総額の3分の1

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券

…信託財産の純資産総額の3分の1

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の3分の1

ハ．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

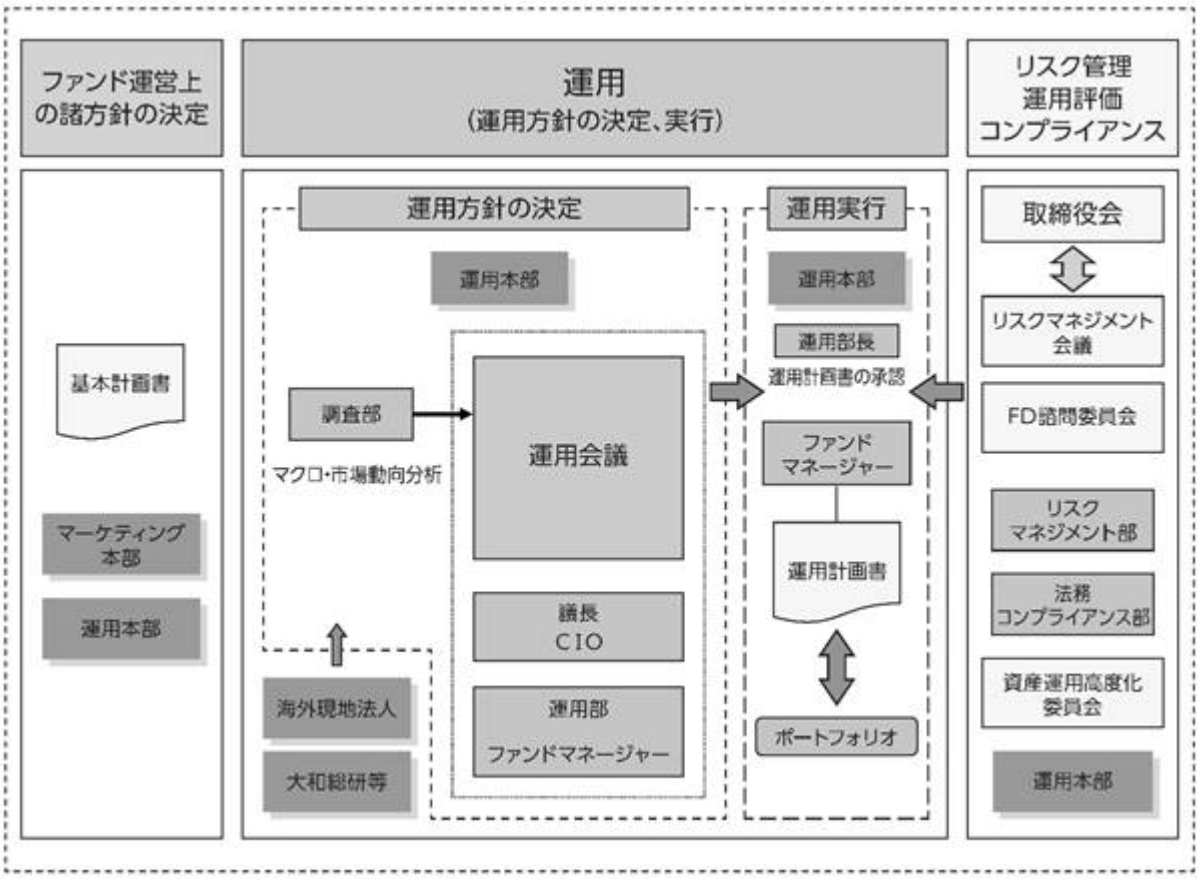
③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③　職務権限

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。

④　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。

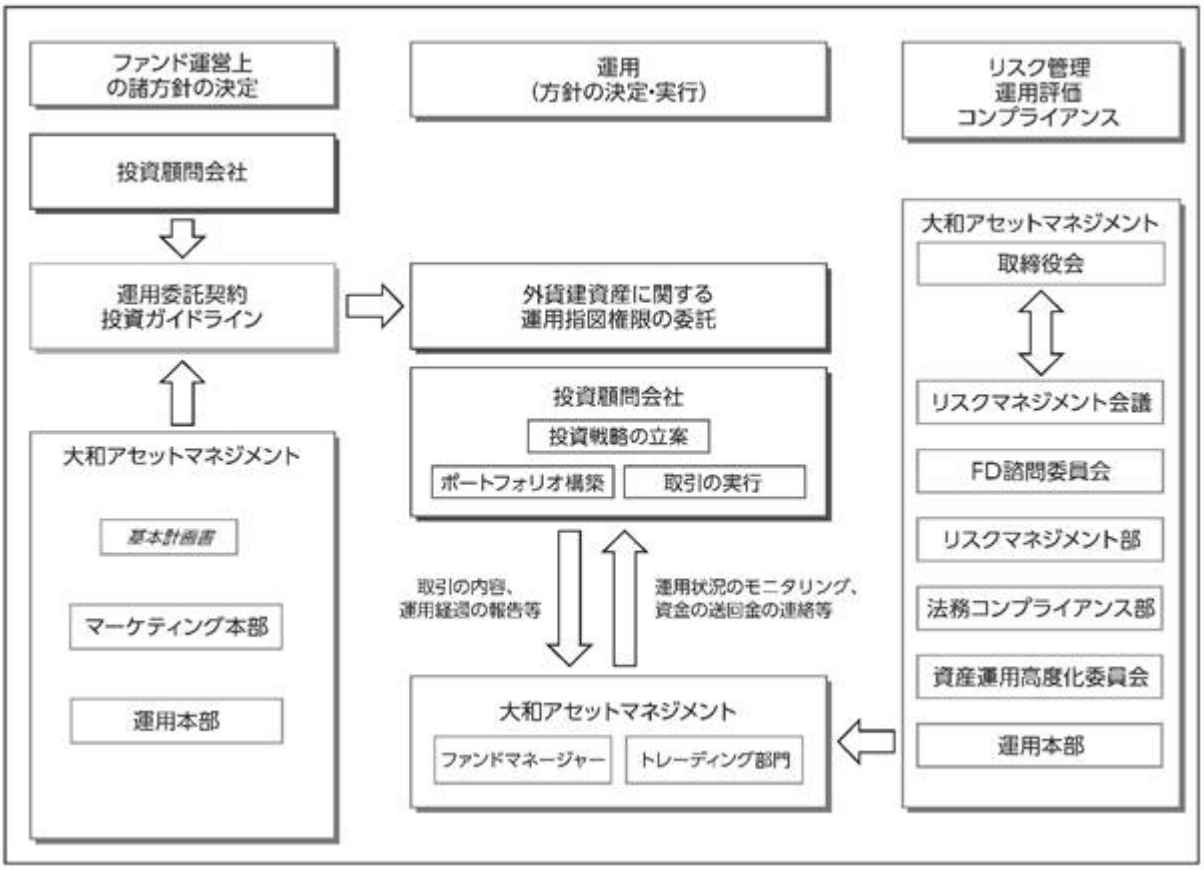
ハ．資産運用高度化委員会

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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

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



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前④に同じ。）

※　上記の運用体制は2021年8月31日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑥　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

海外の金融商品取引所上場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ます。

②　投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York，New York，USA

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

3. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)⑦、⑧および⑨に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③ 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。

④ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権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。

⑤ 同一銘柄の転換社債、ならびに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。

⑥ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑦ 先物取引等

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

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

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

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。

⑧ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑨　金利先渡取引

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。

・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑤　その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

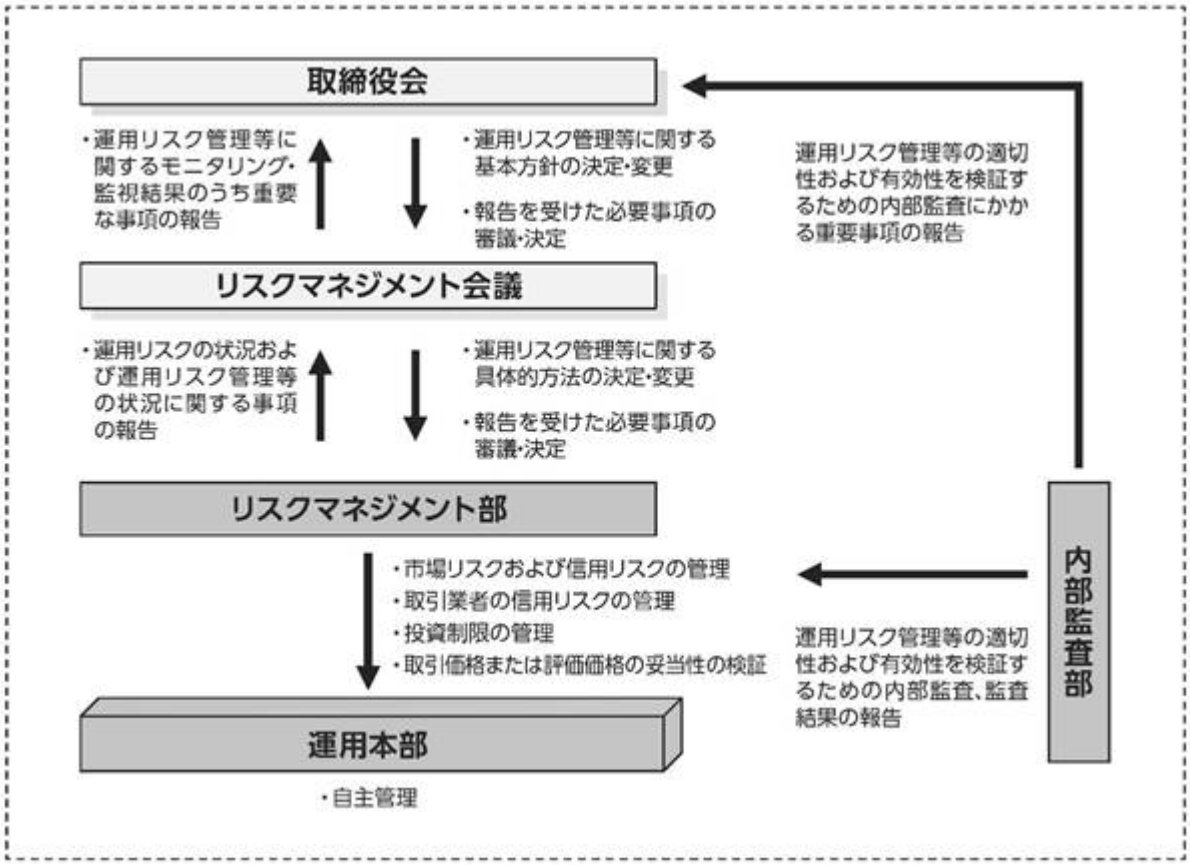
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

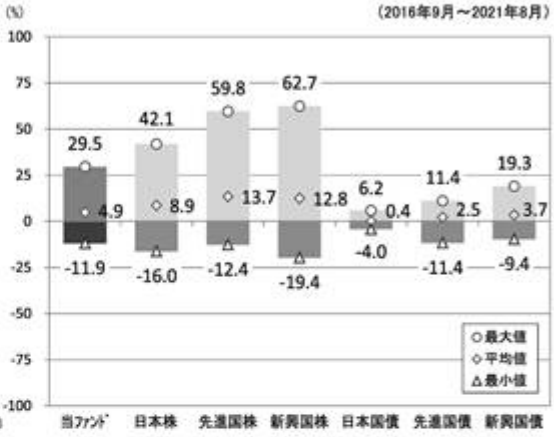
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。
申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。
「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.375%（税抜1.25%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社 （各販売会社の取扱純資産総額に応じて）	受託会社
300億円未満の場合	年率1.25%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.70% （税抜）	年率0.05% （税抜）
300億円以上1,000億円未満の場合		年率0.75% （税抜）	
1,000億円以上の場合		年率0.80% （税抜）	

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

⑤ 委託会社は、ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に年率0.57%以内の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

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

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

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

（※）上記は、2021年8月31日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2021年8月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	242,159,370	99.06
内 日本	242,159,370	99.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,308,662	0.94
純資産総額	244,468,032	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8月31日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,720,236	3.4235 84,629,727	3.4574 85,467,743	34.96
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,095,543	3.2757 78,929,770	3.2955 79,406,861	32.48
3	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	40,693,327	1.8960 77,154,547	1.8992 77,284,766	31.61

(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。

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	99.06%
合計	99.06%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第13特定期間末(2012年2月15日)	303,613,222	306,296,186	0.6790	0.6850
第14特定期間末(2012年8月15日)	288,970,032	291,524,728	0.6787	0.6847
第15特定期間末(2013年2月15日)	345,647,968	348,138,994	0.8325	0.8385
第16特定期間末(2013年8月15日)	368,655,474	371,111,233	0.9007	0.9067
第17特定期間末(2014年2月17日)	370,399,375	372,688,957	0.9707	0.9767
第18特定期間末(2014年8月15日)	372,976,308	375,104,660	1.0515	1.0575
第19特定期間末(2015年2月16日)	377,884,048	381,694,563	1.1900	1.2020
第20特定期間末(2015年8月17日)	373,319,715	376,983,105	1.2229	1.2349
第21特定期間末(2016年2月15日)	296,097,677	299,629,178	1.0061	1.0181
第22特定期間末(2016年8月15日)	270,478,770	273,739,773	0.9953	1.0073
第23特定期間末(2017年2月15日)	281,284,153	284,444,389	1.0681	1.0801
第24特定期間末(2017年8月15日)	269,879,530	272,898,542	1.0727	1.0847

第25特定期間末 (2018年2月15日)	249,551,015	252,365,262	1.0641	1.0761
第26特定期間末 (2018年8月15日)	246,600,018	249,391,895	1.0599	1.0719
第27特定期間末 (2019年2月15日)	232,049,064	234,783,227	1.0184	1.0304
第28特定期間末 (2019年8月15日)	214,573,954	217,217,507	0.9740	0.9860
第29特定期間末 (2020年2月17日)	228,913,143	231,485,291	1.0680	1.0800
第30特定期間末 (2020年8月17日)	205,004,097	207,509,582	0.9819	0.9939
2020年8月末日	205,899,483	―	0.9846	―
9月末日	205,798,809	―	0.9706	―
10月末日	200,705,112	―	0.9467	―
11月末日	214,207,861	―	1.0019	―
12月末日	219,955,269	―	1.0301	―
2021年1月末日	217,484,442	―	1.0331	―
第31特定期間末 (2021年2月15日)	222,494,707	225,022,087	1.0564	1.0684
2月末日	221,041,432	―	1.0479	―
3月末日	234,023,565	―	1.1022	―
4月末日	237,423,075	―	1.1173	―
5月末日	242,295,516	―	1.1293	―
6月末日	243,472,700	―	1.1380	―
7月末日	244,602,362	―	1.1429	―
第32特定期間末 (2021年8月16日)	242,846,784	245,416,139	1.1342	1.1462
8月末日	244,468,032	―	1.1403	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0240

第20特定期間	0.0240
第21特定期間	0.0240
第22特定期間	0.0240
第23特定期間	0.0240
第24特定期間	0.0240
第25特定期間	0.0240
第26特定期間	0.0240
第27特定期間	0.0240
第28特定期間	0.0240
第29特定期間	0.0240
第30特定期間	0.0240
第31特定期間	0.0240
第32特定期間	0.0240

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第13特定期間	4.8
第14特定期間	1.7
第15特定期間	24.4
第16特定期間	9.6
第17特定期間	9.1
第18特定期間	9.6
第19特定期間	15.5
第20特定期間	4.8
第21特定期間	△15.8
第22特定期間	1.3
第23特定期間	9.7
第24特定期間	2.7
第25特定期間	1.4
第26特定期間	1.9
第27特定期間	△1.7
第28特定期間	△2.0
第29特定期間	12.1
第30特定期間	△5.8
第31特定期間	10.0
第32特定期間	9.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第13特定期間	1,804,889	53,444,988
第14特定期間	3,270,141	24,648,240
第15特定期間	4,857,402	15,469,060
第16特定期間	18,878,489	24,756,306
第17特定期間	9,265,095	36,961,265
第18特定期間	5,394,264	32,265,964
第19特定期間	10,902,557	48,084,976
第20特定期間	13,610,612	25,870,989
第21特定期間	7,080,155	18,070,929
第22特定期間	2,722,301	25,263,784
第23特定期間	2,437,011	10,834,290
第24特定期間	3,006,659	14,775,322
第25特定期間	1,736,790	18,800,528
第26特定期間	1,034,624	2,898,769
第27特定期間	1,444,360	6,253,844
第28特定期間	1,738,696	9,289,521
第29特定期間	1,606,077	7,556,531
第30特定期間	4,612,374	10,167,646
第31特定期間	7,176,110	5,351,465
第32特定期間	4,318,200	820,318

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2021年8月31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		18,974,304,934	92.95
	内 ユーロ	4,966,189,420	24.33
	内 ノルウェー	266,934,094	1.31
	内 スウェーデン	372,592,873	1.83
	内 デンマーク	559,860,484	2.74
	内 イギリス	2,552,328,543	12.50
	内 ポーランド	1,167,024,699	5.72
	内 カナダ	1,689,562,526	8.28
	内 アメリカ	4,833,851,059	23.68

	内 オーストラリア	2,565,961,236	12.57
特殊債券		979,051,745	4.80
	内 カナダ	979,051,745	4.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		461,007,815	2.26
純資産総額		20,414,364,494	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）		272,342,185	1.33
	内 日本	272,342,185	1.33
為替予約取引（売建）		306,535,680	△1.50
	内 日本	306,535,680	△1.50

(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8月31日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	27,183,400	93.17 2,783,681,307	96.83 2,892,902,687	0.875000 2030/11/15	14.17
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	19,000,000	128.84 1,962,850,499	135.62 2,066,077,438	4.500000 2033/04/21	10.12
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,308,800	106.41 1,790,281,339	107.79 1,813,532,619	2.250000 2027/08/15	8.88
4	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	109.74 1,300,358,655	110.38 1,307,835,045	1.400000 2028/04/30	6.41
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,660,000	111.13 1,248,140,606	111.00 1,246,714,249	1.950000 2026/04/30	6.11
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,750,400	159.08 980,114,517	161.74 996,477,586	3.250000 2045/05/25	4.88

7	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	11,046,000	91.22 878,227,816	94.02 905,140,030	0.500000 2030/12/01	4.43
8	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	110.34 784,423,611	109.12 775,785,993	2.750000 2028/04/25	3.80
9	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,830,000	105.15 717,568,244	105.37 719,049,019	2.250000 2025/12/15	3.52
10	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,320,000	105.86 691,806,842	105.87 691,891,795	1.500000 2026/07/22	3.39
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,545,900	118.59 636,124,331	116.77 626,351,336	5.000000 2025/03/07	3.07
12	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	6,743,000	102.66 603,295,758	103.18 606,386,810	1.500000 2026/06/01	2.97
13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	107.52 520,480,134	108.36 524,555,953	1.625000 2028/10/22	2.57
14	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	93.70 438,812,583	95.93 449,269,422	0.250000 2031/07/31	2.20
15	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	3,172,000	107.52 442,332,775	107.45 442,053,039	1.000000 2026/05/15	2.17
16	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	110.37 388,827,311	109.68 386,393,001	1.750000 2025/11/15	1.89
17	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	110.29 341,510,607	110.85 343,266,310	1.100000 2029/05/15	1.68
18	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	169.26 329,277,722	172.13 334,868,658	3.750000 2045/06/22	1.64
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	114.41 266,030,745	117.38 272,950,600	3.250000 2029/04/21	1.34
20	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	106.66 270,294,178	105.34 266,934,094	3.000000 2024/03/14	1.31
21	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	164.13 248,283,989	172.05 260,260,035	4.250000 2046/12/07	1.27
22	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,815,000	106.34 260,893,264	105.98 260,002,726	2.550000 2025/03/15	1.27
23	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,307,000	122.49 226,585,444	122.68 226,933,198	4.750000 2027/04/21	1.11

24	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,000,000	96.78 220,178,906	96.81 220,247,154	1.250000 2030/10/25	1.08
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	105.80 191,815,909	105.90 192,000,825	1.000000 2026/11/12	0.94
26	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	104.68 181,776,315	104.00 180,592,048	1.500000 2023/11/13	0.88
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	131.78 172,279,863	136.19 178,035,684	3.500000 2045/12/01	0.87
28	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	5,500,000	178.46 171,178,832	180.84 173,467,483	4.500000 2039/11/15	0.85
29	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,000,000	99.94 170,529,171	100.21 170,991,550	0.750000 2025/04/25	0.84
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	695,000	158.58 142,938,974	164.76 148,513,796	2.500000 2046/08/15	0.73

(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	92.95%
特殊債券	4.80%
合計	97.74%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率

為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2021年9月	買建	1,784,291	142,076,000	143,046,633	0.70%
		米ドル買/円売 2021年9月	買建	1,176,912	129,160,000	129,295,552	0.63%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2021年9月	売建	1,200,000	33,973,200	34,123,680	△0.17%
		ユーロ売/円買 2021年9月	売建	2,100,000	271,236,000	272,412,000	△1.33%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資状況（2021年8月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		90,549,264,415	96.68
	内 香港	2,882,185,844	3.08
	内 シンガポール	6,622,767,276	7.07
	内 イギリス	9,895,632,608	10.57
	内 オランダ	1,082,857,072	1.16
	内 ベルギー	4,386,114,511	4.68
	内 フランス	4,537,111,868	4.84
	内 ドイツ	537,020,643	0.57
	内 スペイン	613,997,595	0.66
	内 カナダ	1,656,194,901	1.77
	内 アメリカ	44,634,837,973	47.65
	内 オーストラリア	12,825,755,266	13.69
	内 ニュージーランド	874,788,858	0.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,114,299,078	3.32
純資産総額		93,663,563,493	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)		540,396,585	0.58
	内 日本	540,396,585	0.58

為替予約取引(売建)		537,005,496	△0.57
	内 日本	537,005,496	△0.57

(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8月31日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,095,654	1,348.70 2,826,533,118	1,812.86 3,799,147,848	4.06
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	92,735	26,963.63 2,500,476,362	35,228.44 3,266,909,847	3.49
3	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,128,207	945.80 2,013,020,256	1,399.94 2,979,368,067	3.18
4	LINK REIT	香港	投資証券	2,838,992	1,017.62 2,889,074,280	1,015.21 2,882,185,844	3.08
5	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	504,870	4,512.05 2,278,027,228	5,701.61 2,878,572,850	3.07
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	193,376	13,183.38 2,549,366,609	14,661.75 2,835,232,308	3.03
7	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,486,107	193.87 2,033,377,597	249.35 2,614,813,544	2.79
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	273,292	8,693.85 2,375,968,850	9,425.02 2,575,783,659	2.75
9	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	26,033	75,514.04 1,965,858,273	92,319.29 2,403,348,259	2.57
10	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	424,905	4,518.53 1,919,987,531	5,516.98 2,344,192,387	2.50
11	UDR INC	アメリカ	投資証券	385,502	5,011.44 1,931,941,678	5,875.25 2,264,922,168	2.42
12	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	563,624	3,509.98 1,978,371,246	3,934.42 2,217,533,538	2.37
13	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	146,909	11,233.86 1,650,371,054	14,696.92 2,159,110,849	2.31

14	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	12,635,232	172.67 2,182,725,587	170.06 2,148,757,662	2.29
15	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,991,877	340.28 1,699,003,551	400.62 1,999,865,731	2.14
16	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	1,094,434	1,859.17 2,034,835,496	1,797.96 1,967,752,932	2.10
17	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,000,647	1,454.00 1,455,088,087	1,939.28 1,940,536,115	2.07
18	KLEPIERRE	フランス	投資証券	704,489	2,749.81 1,937,302,191	2,711.81 1,910,445,881	2.04
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	52,491	32,178.28 1,689,072,479	35,915.32 1,885,231,062	2.01
20	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,318,198	775.56 1,798,244,673	802.33 1,859,973,896	1.99
21	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	198,334	7,240.21 1,435,980,207	8,439.22 1,673,784,458	1.79
22	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	845,748	1,945.88 1,645,760,149	1,958.26 1,656,194,901	1.77
23	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	236,197	6,227.04 1,470,817,237	6,091.75 1,438,854,728	1.54
24	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	69,839	14,664.50 1,024,158,803	20,402.93 1,424,920,577	1.52
25	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	64,032	16,435.10 1,052,376,268	22,227.27 1,423,256,873	1.52
26	WAREHOUSES DE PAUW SCA	ベルギー	投資証券	282,418	4,216.35 1,190,781,482	4,995.65 1,410,863,967	1.51
27	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	393,969	3,143.03 1,238,298,532	3,379.42 1,331,388,688	1.42
28	AEDIFICA	ベルギー	投資証券	82,585	12,891.57 1,064,652,234	15,964.83 1,318,456,229	1.41
29	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	52,270	23,676.41 1,237,570,020	25,081.37 1,311,003,628	1.40
30	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証券	3,405,473	293.91 1,001,262,591	356.99 1,215,744,326	1.30

(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。

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	96.68%
合計	96.68%

(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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2021年9月	買建	6,739,818	537,500,485	540,396,585	0.58%
		米ドル売/円買 2021年9月	売建	4,886,368	537,500,485	537,005,496	△0.57%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況（2021年8月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		15,381,900,300	97.85
	内 日本	15,381,900,300	97.85
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		338,419,281	2.15
純資産総額		15,720,319,581	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8月31日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日立	日本	株式	電気機器	88,500	5,121.00 453,208,500	6,085.00 538,522,500	3.43
2	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	51,200	8,564.00 438,476,800	9,592.00 491,110,400	3.12
3	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	43,200	6,956.00 300,499,200	9,068.00 391,737,600	2.49
4	AGC	日本	株式	ガラス・土石製品	72,600	4,905.00 356,103,000	5,320.00 386,232,000	2.46
5	武田薬品	日本	株式	医薬品	102,600	3,715.00 381,159,000	3,679.00 377,465,400	2.40
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	98,700	3,910.00 385,917,000	3,801.00 375,158,700	2.39
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	110,600	3,448.00 381,348,800	3,370.00 372,722,000	2.37
8	東京海上HD	日本	株式	保険業	68,300	5,366.00 366,497,800	5,377.00 367,249,100	2.34
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	6,700	48,940.00 327,898,000	47,240.00 316,508,000	2.01
10	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	514,500	591.60 304,378,200	594.40 305,818,800	1.95
11	デクセリアルズ	日本	株式	化学	131,000	1,969.00 257,939,000	2,153.00 282,043,000	1.79
12	富士電機	日本	株式	電気機器	58,000	4,930.00 285,940,000	4,765.00 276,370,000	1.76
13	オリックス	日本	株式	その他金融業	132,400	1,822.50 241,299,000	2,051.50 271,618,600	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	1,392.00 248,611,200	1.58
15	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	81,600	2,856.00 233,049,600	2,936.00 239,577,600	1.52
16	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	24,400	10,490.00 255,956,000	9,520.00 232,288,000	1.48
17	旭化成	日本	株式	化学	200,500	1,231.00 246,815,500	1,136.00 227,768,000	1.45

18	三菱商事	日本	株式	卸売業	68,200	3,287.55 224,210,930	3,311.00 225,810,200	1.44
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	3,440.00 214,656,000	1.37
20	ダイワボウHD	日本	株式	卸売業	99,800	1,757.83 175,431,486	2,092.00 208,781,600	1.33
21	大日本印刷	日本	株式	その他製品	74,300	2,307.89 171,476,304	2,616.00 194,368,800	1.24
22	デンソー	日本	株式	輸送用機器	24,900	7,242.00 180,325,800	7,710.00 191,979,000	1.22
23	MS＆AD	日本	株式	保険業	54,000	3,180.00 171,720,000	3,555.00 191,970,000	1.22
24	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	81,600	2,014.00 164,342,400	2,169.50 177,031,200	1.13
25	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	191,000	941.00 179,731,000	917.00 175,147,000	1.11
26	IHI	日本	株式	機械	70,800	2,218.00 157,034,400	2,446.00 173,176,800	1.10
27	信越化学	日本	株式	化学	9,100	18,885.00 171,853,500	18,205.00 165,665,500	1.05
28	村田製作所	日本	株式	電気機器	17,700	9,045.00 160,096,500	9,119.00 161,406,300	1.03
29	三井住友トラストHD	日本	株式	銀行業	44,200	3,768.00 166,545,600	3,598.00 159,031,600	1.01
30	リコー	日本	株式	電気機器	139,900	1,189.00 166,341,100	1,120.00 156,688,000	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	97.85%
合計	97.85%

(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
建設業	3.07%
食料品	1.87%
繊維製品	1.93%

化学	12.98%
医薬品	2.40%
ゴム製品	0.62%
ガラス・土石製品	3.43%
鉄鋼	0.67%
非鉄金属	2.13%
金属製品	2.18%
機械	4.67%
電気機器	11.88%
輸送用機器	7.13%
精密機器	0.56%
その他製品	2.91%
陸運業	1.61%
倉庫・運輸関連業	0.96%
情報・通信業	7.17%
卸売業	9.65%
小売業	2.44%
銀行業	5.34%
証券、商品先物取引業	0.63%
保険業	4.68%
その他金融業	3.09%
不動産業	1.22%
サービス業	2.61%
合計	97.85%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)

2021年8月31日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,403円
純資産総額	2.4億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	2.0%
6カ月間	11.2%
1年間	21.1%
3年間	21.7%
5年間	43.0%
設定来	120.5%

※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：　480円　　設定来分配金合計額：　6,420円

決算期	第57期 18年11月	第58期 19年2月	第59期 19年5月	第60期 19年8月	第61期 19年11月	第62期 20年2月	第63期 20年5月	第64期 20年8月	第65期 20年11月	第66期 21年2月	第67期 21年5月	第68期 21年8月
分配金	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円	120円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート	70	33.8%
国内株式	119	31.8%
外国債券	32	30.9%
コール・ローン、その他		3.5%
合計	221	100.0%

通貨別構成	比率
日本円	33.6%
米ドル	25.1%
ユーロ	11.6%
豪ドル	9.1%
英ポンド	7.8%
カナダ・ドル	4.9%
シンガポール・ドル	2.6%
ポーランド・ズロチ	2.0%
香港ドル	1.1%
その他	2.2%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.8
最終利回り(%)	0.7
修正デュレーション	7.8
残存年数	8.9

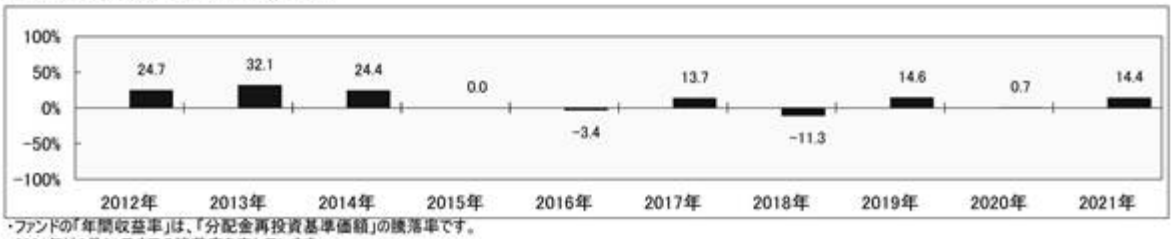
債券格付別構成	比率
AAA	76.7%
AA	17.5%
A	5.8%
BBB	－
BB	－
合計	100.0%

	組入上位銘柄	業種・用途名	比率
株式	日 立	電気機器	1.1%
株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1.0%
株式	富士フイルムHLDGS	化学	0.8%
株式	AGC	ガラス・土石製品	0.8%
株式	武田薬品	医薬品	0.8%
リート	GOODMAN GROUP	産業施設	1.4%
リート	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	1.2%
リート	CHARTER HALL GROUP	各種不動産	1.1%
リート	LINK REIT	商業施設	1.1%
リート	DUKE REALTY CORP	産業施設	1.1%
	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。
※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。
※業種・用途名について、株式は東証33業種分類、リートはS&P Global Property Indexの分類を原則としています。

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8月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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。

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

＜一部解約＞

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

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・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

・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。

・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。

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年2月16日から5月15日まで、5月16日から8月15日まで、8月16日から11月15日まで、および11月16日から翌年2月15日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

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

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

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

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

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

② 信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年2月および8月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

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】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2021年2月16日から2021年8月16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】

ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2021年2月15日現在	当　期 2021年8月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,330,580	5,548,351
親投資信託受益証券	220,448,998	240,714,044
流動資産合計	225,779,578	246,262,395
資産合計	225,779,578	246,262,395
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,527,380	2,569,355
未払受託者報酬	29,923	33,446
未払委託者報酬	718,918	803,118
その他未払費用	8,650	9,692
流動負債合計	3,284,871	3,415,611
負債合計	3,284,871	3,415,611
純資産の部		
元本等		
元本	※1 210,615,077	※1 214,112,959
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,879,630	28,733,825
（分配準備積立金）	2,293,085	17,965,401
元本等合計	222,494,707	242,846,784
純資産合計	222,494,707	242,846,784
負債純資産合計	225,779,578	246,262,395

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年8月18日 至　2021年2月15日	当　期 自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
営業収益		
有価証券売買等損益	22,521,331	23,265,046
営業収益合計	22,521,331	23,265,046
営業費用		
支払利息	263	235
受託者報酬	58,232	65,197
委託者報酬	※1 1,398,866	※1 1,565,680
その他費用	8,652	9,693
営業費用合計	1,466,013	1,640,805
営業利益	21,055,318	21,624,241
経常利益	21,055,318	21,624,241
当期純利益	21,055,318	21,624,241
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	101,567	33,133
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 3,786,335	11,879,630
剰余金増加額又は欠損金減少額	－	463,691
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	463,691
剰余金減少額又は欠損金増加額	191,419	80,760
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,266	80,760
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	178,153	－
分配金	※2 5,096,367	※2 5,119,844
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,879,630	28,733,825

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日 2021年8月15日が休日のため、当特定期間末日を2021年8月16日としております。このため、当特定期間は182日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2021年2月15日現在	当　期 2021年8月16日現在
1．※1　期首元本額	208,790,432円	210,615,077円
期中追加設定元本額	7,176,110円	4,318,200円
期中一部解約元本額	5,351,465円	820,318円
2．特定期間末日における受益権の総数	210,615,077口	214,112,959口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年8月18日 至　2021年2月15日	当　期 自　2021年2月16日 至　2021年8月16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	178,369円	205,183円

2．※2 分配金の計算過程	（自2020年8月18日　至2020年11月16日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,576,823円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（35,137,528円）及び分配準備積立金（4,990,761円）より分配対象額は41,705,112円（1万口当たり1,948.09円）であり、うち2,568,987円（1万口当たり120円）を分配金額としております。 （自2020年11月17日　至2021年2月15日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（920,786円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（34,603,922円）及び分配準備積立金（3,899,679円）より分配対象額は39,424,387円（1万口当たり1,871.87円）であり、うち2,527,380円（1万口当たり120円）を分配金額としております。	（自2021年2月16日　至2021年5月17日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,848,069円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（10,834,426円）、投資信託約款に規定される収益調整金（34,950,866円）及び分配準備積立金（2,291,424円）より分配対象額は49,924,785円（1万口当たり2,348.95円）であり、うち2,550,489円（1万口当たり120円）を分配金額としております。 （自2021年5月18日　至2021年8月16日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（976,512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（7,173,409円）、投資信託約款に規定される収益調整金（35,340,901円）及び分配準備積立金（12,384,835円）より分配対象額は55,875,657円（1万口当たり2,609.63円）であり、うち2,569,355円（1万口当たり120円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年8月16日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	前　期 2021年2月15日現在	当　期 2021年8月16日現在

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	14,321,761	8,748,486
合計	14,321,761	8,748,486

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2021年2月15日現在	当　期 2021年8月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2021年2月15日現在	当　期 2021年8月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0564円 (10,564円)	1.1342円 (11,342円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	40,693,327	77,154,547	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	24,720,236	84,629,727	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	24,095,543	78,929,770	
親投資信託受益証券　合計			240,714,044	
合計			240,714,044	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・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、当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	19,059,679	258,497,572
コール・ローン	3,154,223	31,576,429
国債証券	19,781,013,272	18,952,862,537
特殊債券	947,073,258	980,716,110
派生商品評価勘定	733,072	1,576,260
未収入金	56,851,726	－
未収利息	180,898,678	118,211,359
前払費用	2,158,623	3,783,868
その他未収収益	37,843	－
差入委託証拠金	125,768,138	128,854,680
流動資産合計	21,116,748,512	20,476,078,815
資産合計	21,116,748,512	20,476,078,815
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,747,644	1,145,627

未払解約金	23,000,664	17,233,497
流動負債合計	24,748,308	18,379,124
負債合計	24,748,308	18,379,124
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	11,385,894,338	10,790,162,894
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,706,105,866	9,667,536,797
元本等合計	21,092,000,204	20,457,699,691
純資産合計	21,092,000,204	20,457,699,691
負債純資産合計	21,116,748,512	20,476,078,815

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2月16日 至　2021年8月16日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1．※1　期首	2020年8月18日	2021年2月16日
期首元本額	12,454,915,110円	11,385,894,338円
期中追加設定元本額	143,384,186円	107,806,003円
期中一部解約元本額	1,212,404,958円	703,537,447円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワFOFs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,337,986,581円	1,304,541,251円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	699,546,576円	658,843,333円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	38,578,190円	40,693,327円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	133,690,815円	128,882,856円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	235,222,379円	230,981,140円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	350,515,588円	339,564,954円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	178,098,091円	171,419,668円
６資産バランスファンド（分配型）	829,072,444円	807,751,885円
６資産バランスファンド（成長型）	98,516,846円	100,645,804円

	ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	4,831,411,932円	4,485,444,139円
	世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	51,889,173円	46,119,653円
	ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	188,948,433円	177,218,388円
	兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	700,529,269円	713,302,933円
	『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	15,858,903円	－円
	ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	182,435,582円	169,741,890円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	768,214,057円	726,373,984円
	ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	20,274,047円	17,427,557円
	四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	552,141,725円	522,637,344円
	四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	172,963,707円	148,572,788円
	計	11,385,894,338円	10,790,162,894円
2.	期末日における受益権の総数	11,385,894,338口	10,790,162,894口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年8月16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	2021年2月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年8月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△444,172,940	328,009,293
特殊債券	△9,745,124	△103,137
合計	△453,918,064	327,906,156

（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（2020年10月13日から2021年2月15日まで、及び2021年4月13日から2021年8月16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	2021年2月15日 現在				2021年8月16日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	183,737,014	－	185,481,335	△1,744,321	272,832,000	－	271,255,740	1,576,260
アメリカ・ドル	126,710,251	－	128,457,895	△1,747,644	－	－	－	－
イギリス・ポンド	57,026,763	－	57,023,440	3,323	－	－	－	－
ユーロ	－	－	－	－	272,832,000	－	271,255,740	1,576,260
買　建	126,710,251	－	127,440,000	729,749	272,832,000	－	271,686,373	△1,145,627
アメリカ・ドル	－	－	－	－	129,920,000	－	129,380,441	△539,559
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	142,912,000	－	142,305,932	△606,068
ユーロ	126,710,251	－	127,440,000	729,749	－	－	－	－
合計	310,447,265	－	312,921,335	△1,014,572	545,664,000	－	542,942,113	430,633

（注）　1．時価の算定方法

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

①　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・　期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1口当たり純資産額	1.8525円	1.8960円
（1万口当たり純資産額）	(18,525円)	(18,960円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	15,308,800.000	16,487,424.510	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,300,000.000	1,150,747.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	27,183,400.000	26,279,551.940	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 43,917,723.450 (4,809,429,895)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,320,000.000	4,573,843.200	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	3,469,984.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,972,398.260	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	3,545,900.000	4,146,752.750	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,732,960.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド	

			16,895,938.210 (2,563,789,663)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	オーストラリア・ドル 2,307,000.000	オーストラリア・ドル 2,826,144.210	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	3,391,753.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	25,639,740.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 31,857,637.210 (2,565,495,524)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 2,034,735.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	6,743,000.000	6,948,998.650	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	11,046,000.000	10,375,286.880	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 19,359,020.530 (1,691,204,034)	
スウェーデン・クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	スウェーデン・クローナ 13,630,000.000	スウェーデン・クローナ 14,182,969.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	15,082,519.300	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 29,265,488.400 (370,793,738)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,500,000.000	デンマーク・クローネ 10,024,245.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	22,208,688.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 32,232,933.000 (559,886,046)	

	ノルウェー・クローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	ノルウェー・クローネ 20,000,000.000	ノルウェー・クローネ 21,082,200.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 21,082,200.000 (261,840,924)	
	ポーランド・ズロチ	0.75% Poland Government Bond 20250425	ポーランド・ズロチ 6,000,000.000	ポーランド・ズロチ 5,993,160.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	8,000,000.000	7,740,160.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	27,263,750.000	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 40,997,070.000 (1,159,634,922)	
	ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	ユーロ 695,000.000	ユーロ 1,157,001.250	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	4,750,400.000	7,765,668.890	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,608,635.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	3,172,000.000	3,414,404.240	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,653,411.500	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	8,660,000.000	9,637,800.600	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	10,120,495.360	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	1,110,000.000	1,131,067.800	
	ユーロ　小計			ユーロ 38,488,484.640 (4,970,787,791)	
国債証券　合計				18,952,862,537 [18,952,862,537]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 2,815,000.000	カナダ・ドル 2,984,209.650	

		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,830,000.000	8,241,936.300	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 11,226,145.950 (980,716,110)	
特殊債券　合計				980,716,110 [980,716,110]	
合計				19,933,578,647 [19,933,578,647]	

（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　3銘柄	100%	24.1%
イギリス・ポンド	国債証券　5銘柄	100%	12.9%
オーストラリア・ドル	国債証券　3銘柄	100%	12.9%
カナダ・ドル	国債証券　3銘柄 特殊債券　2銘柄	100%	13.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券　2銘柄	100%	1.9%
デンマーク・クローネ	国債証券　2銘柄	100%	2.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券　1銘柄	100%	1.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券　3銘柄	100%	5.8%
ユーロ	国債証券　8銘柄	100%	24.9%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・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2月15日現在	2021年8月16日現在
	金　額（円）	金　額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	1,895,640,870	3,272,736,140
コール・ローン	546,803,204	1,041,863,826
投資証券	74,198,330,783	89,103,006,938
派生商品評価勘定	419,412	770
未収入金	370,628,577	264,756,828
未収配当金	185,409,169	250,876,642
流動資産合計	77,197,232,015	93,933,241,144
資産合計	77,197,232,015	93,933,241,144
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	408,000	25,378
未払金	237,560,407	482,793,486
未払解約金	113,656,000	399,717,000
流動負債合計	351,624,407	882,535,864
負債合計	351,624,407	882,535,864
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	27,654,243,201	27,180,010,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	49,191,364,407	65,870,694,369
元本等合計	76,845,607,608	93,050,705,280
純資産合計	76,845,607,608	93,050,705,280
負債純資産合計	77,197,232,015	93,933,241,144

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2月16日 至　2021年8月16日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1．※1　期首	2020年8月18日	2021年2月16日
期首元本額	30,012,913,293円	27,654,243,201円
期中追加設定元本額	107,416,311円	1,435,861,475円

期中一部解約元本額	2,466,086,403円	1,910,093,765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）	24,067,325,878円	23,032,181,570円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	26,546,951円	24,720,236円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,532,585円	10,271,549円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,078,785円	9,150,085円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	60,910,137円	47,512,397円
６資産バランスファンド（分配型）	111,683,328円	91,526,815円
６資産バランスファンド（成長型）	282,172,121円	252,122,500円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,227,369,422円	1,114,414,631円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	35,545,863円	26,347,929円
『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	2,722,660円	－円
常陽３分法ファンド	154,983,611円	115,312,412円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	36,666,314円	28,695,095円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	326,292,980円	306,175,130円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	400,944,424円	384,086,017円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	539,306,269円	552,719,094円
グローバルＲＥＩＴファンド2021-07（適格機関投資家専用）	－円	881,939,728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）	308,021,057円	259,502,335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）	23,738,856円	19,635,310円
ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	26,401,960円	23,698,078円
計	27,654,243,201円	27,180,010,911円
2. 期末日における受益権の総数	27,654,243,201口	27,180,010,911口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年8月16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	2021年2月15日現在	2021年8月16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	5,144,689,368	11,202,913,825
合計	5,144,689,368	11,202,913,825

（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（2020年9月16日から2021年2月15日まで、及び2021年3月16日から2021年8月16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	2021年2月15日 現在				2021年8月16日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	139,490,537	－	139,887,499	△396,962	84,390,590	－	84,389,820	770
アメリカ・ドル	21,673,044	－	21,670,982	2,062	84,390,590	－	84,389,820	770
イギリス・ポンド	9,918,675	－	10,000,273	△81,598	－	－	－	－
ユーロ	83,578,104	－	83,787,438	△209,334	－	－	－	－
香港・ドル	24,320,714	－	24,428,806	△108,092	－	－	－	－
買　建	139,490,537	－	139,898,911	408,374	84,390,590	－	84,365,212	△25,378

アメリカ・ドル	117,817,493	－	118,190,397	372,904	－	－	－	－
イギリス・ポンド	21,673,044	－	21,708,514	35,470	1,241,882	－	1,240,734	△1,148
ユーロ	－	－	－	－	83,148,708	－	83,124,478	△24,230
合計	278,981,074	－	279,786,410	11,412	168,781,180	－	168,755,032	△24,608

（注） 1. 時価の算定方法

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

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1口当たり純資産額	2.7788円	3.4235円
（1万口当たり純資産額）	(27,788円)	(34,235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	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,270	11,737,228.500	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	193,376	25,848,569.920	
		EQUINIX INC	26,674	21,715,036.660	

		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,094,434	17,412,444.940	
		CYRUSONE INC	198,334	14,972,233.660	
		KIMCO REALTY CORP	444,274	9,791,798.960	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	275,382	8,096,230.800	
		INVITATION HOMES INC	86,841	3,440,640.420	
		AMERICOLD REALTY TRUST	217,467	8,052,803.010	
		VICI PROPERTIES INC	393,969	11,830,889.070	
		APARTMENT INCOME REIT CO	184,174	9,284,211.340	
		VENTAS INC	236,197	13,484,486.730	
		WEYERHAEUSER CO	129,012	4,492,197.840	
		VEREIT INC	424,905	21,304,736.700	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	131,771	6,707,143.900	
		SUN COMMUNITIES INC	73,893	14,607,907.170	
		PROLOGIS INC	146,909	19,389,049.820	
		COUSINS PROPERTIES INC	159,414	6,274,535.040	
		SITE CENTERS CORP	137,129	2,152,925.300	
		DUKE REALTY CORP	504,870	25,743,321.300	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	52,491	16,637,022.450	
		WELLTOWER INC	273,292	23,259,882.120	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	563,624	20,194,647.920	
		REALTY INCOME CORP	22,628	1,628,084.600	
		PUBLIC STORAGE	92,735	29,180,922.450	
		REGENCY CENTERS CORP	86,647	5,737,764.340	
		UDR INC	385,502	20,620,501.980	
		AGREE REALTY CORP	55,255	4,110,419.450	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,069	7,170,477.900	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	69,839	12,269,315.520	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 397,147,429.810 (43,491,615,039)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		ASSURA PLC	8,252,211	6,473,859.520	
		NEWRIVER REIT PLC	1,733,771	1,454,633.860	
		SEGRO PLC	1,000,647	12,628,165.140	
		BRITISH LAND CO PLC	2,318,198	12,342,086.150	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	376,154	3,016,755.080	
		DERWENT LONDON PLC	56,093	2,116,388.890	
		WORKSPACE GROUP PLC	409,018	3,852,949.560	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	473,502	5,303,222.400	
	BIG YELLOW GROUP PLC	138,012	2,099,162.520	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,979,929	7,718,016.110	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	3,405,473	7,880,264.520	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 64,885,503.750 (9,845,726,339)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	1,149,340	12,160,017.200	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,637,577	12,628,172.480	
	MIRVAC GROUP	11,212,215	33,636,645.000	
	GOODMAN GROUP	2,145,273	48,804,960.750	
	CHARTER HALL GROUP	2,252,185	37,904,273.550	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	1,893,282	11,492,221.740	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 156,626,290.720 (12,613,115,192)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	845,748	18,716,403.240	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 18,716,403.240 (1,635,064,987)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	1,275,541	3,239,874.140	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	8,118,000	12,339,360.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	12,635,232	27,039,396.480	
	KEPPEL REIT	13,617,900	15,524,406.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,991,877	23,861,172.060	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 82,004,208.680 (6,627,580,146)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,272,952	10,896,027.600	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 10,896,027.600 (839,103,086)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	236,888	4,259,246.240	

		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	93,593	7,123,363.230	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	262,124	5,965,942.240	
		NSI NV	68,097	2,471,921.100	
		ICADE	117,768	8,915,037.600	
		ARGAN	27,408	3,097,104.000	
		GECINA SA	11,832	1,601,461.200	
		KLEPIERRE	704,489	14,899,942.350	
		AEDIFICA	82,585	10,190,989.000	
		COFINIMMO	46,662	6,593,340.600	
		BEFIMMO	99,277	3,564,044.300	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	264,287	10,122,192.100	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	52,180	2,942,952.000	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	454,429	4,484,305.370	
	ユーロ　小計			ユーロ 86,231,841.330 (11,136,842,307)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	2,838,992	207,104,466.400	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 207,104,466.400 (2,913,959,842)	
投資証券　合計				89,103,006,938 [89,103,006,938]	
合計				89,103,006,938 [89,103,006,938]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券　30銘柄	100%	48.9%
イギリス・ポンド	投資証券　11銘柄	100%	11.0%
オーストラリア・ドル	投資証券　6銘柄	100%	14.2%
カナダ・ドル	投資証券　1銘柄	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券　5銘柄	100%	7.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券　1銘柄	100%	0.9%
ユーロ	投資証券　14銘柄	100%	12.5%

香港・ドル	投資証券	1銘柄	100%	3.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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

	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	56,356,719	232,138,721
株式	15,524,711,340	15,364,635,300
未収入金	393,342,530	－
未収配当金	29,525,150	24,467,450
流動資産合計	16,003,935,739	15,621,241,471
資産合計	16,003,935,739	15,621,241,471
負債の部		
流動負債		
未払解約金	58,041,000	9,660,000
流動負債合計	58,041,000	9,660,000
負債合計	58,041,000	9,660,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	5,174,279,880	4,765,824,010
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,771,614,859	10,845,757,461
元本等合計	15,945,894,739	15,611,581,471
純資産合計	15,945,894,739	15,611,581,471
負債純資産合計	16,003,935,739	15,621,241,471

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2月16日 至　2021年8月16日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1．※1　期首	2020年8月18日	2021年2月16日
期首元本額	5,904,051,505円	5,174,279,880円
期中追加設定元本額	54,613,473円	217,813,681円
期中一部解約元本額	784,385,098円	626,269,551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）	3,393,811,565円	2,930,241,383円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	24,405,943円	24,095,543円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	23,112,979円	21,251,498円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	20,596,695円	19,042,127円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	395,744,227円	344,019,264円

	ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	66,214,110円	56,423,710円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	67,759,037円	59,336,514円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	201,074,079円	208,345,669円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	365,910,987円	392,247,176円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	615,650,258円	710,821,126円
	計	5,174,279,880円	4,765,824,010円
2.	期末日における受益権の総数	5,174,279,880口	4,765,824,010口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年2月16日 至　2021年8月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年8月16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	2021年2月15日現在	2021年8月16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	2,600,861,906	83,566,570
合計	2,600,861,906	83,566,570

（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（2020年10月16日から2021年2月15日まで、及び2021年4月16日から2021年8月16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

2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年2月15日現在	2021年8月16日現在
1口当たり純資産額	3.0818円	3.2757円
（1万口当たり純資産額）	(30,818円)	(32,757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	
オリエンタル白石	304,500	274.00	83,433,000	
五洋建設	53,200	690.00	36,708,000	
住友林業	22,600	2,012.00	45,471,200	
大和ハウス	35,000	3,324.00	116,340,000	

協和エクシオ	27,500	2,689.00	73,947,500	
日本工営	7,700	3,100.00	23,870,000	
九電工	30,400	3,795.00	115,368,000	
ブルボン	22,800	2,458.00	56,042,400	
日鉄ソリューションズ	24,100	3,610.00	87,001,000	
ディップ	33,100	3,250.00	107,575,000	
アサヒグループホールディン	23,700	5,056.00	119,827,200	
エレマテック	22,400	1,107.00	24,796,800	
パルグループＨＬＤＧＳ	67,300	1,530.00	102,969,000	
太陽化学	22,600	1,730.00	39,098,000	
日本たばこ産業	35,500	2,148.50	76,271,750	
アルコニックス	50,200	1,621.00	81,374,200	
あい　ホールディングス	23,300	2,051.00	47,788,300	
富士紡ホールディングス	16,700	4,040.00	67,468,000	
ダイワボウＨＤ	99,800	1,999.00	199,500,200	
レスターホールディングス	11,500	1,912.00	21,988,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	191,000	897.00	171,327,000	
三洋貿易	146,400	1,149.00	168,213,600	
帝国繊維	15,600	1,916.00	29,889,600	
旭　化　成	200,500	1,172.00	234,986,000	
川田テクノロジーズ	13,100	3,765.00	49,321,500	
ハウスドゥ	48,400	964.00	46,657,600	
コメダホールディングス	32,200	2,028.00	65,301,600	
共和レザー	66,600	688.00	45,820,800	
セーレン	42,000	2,030.00	85,260,000	
ワコールホールディングス	52,300	2,395.00	125,258,500	
ＳＲＡホールディングス	7,700	2,702.00	20,805,400	
昭和電工	28,300	3,280.00	92,824,000	
日本曹達	32,000	3,460.00	110,720,000	
大阪ソーダ	21,900	2,519.00	55,166,100	
信越化学	9,100	17,590.00	160,069,000	
エア・ウォーター	76,900	1,802.00	138,573,800	
四国化成	46,000	1,274.00	58,604,000	
東京応化工業	11,300	7,030.00	79,439,000	
旭有機材	55,800	1,419.00	79,180,200	
第一工業製薬	46,900	3,280.00	153,832,000	
武田薬品	102,600	3,638.00	373,258,800	
日本空調サービス	77,200	705.00	54,426,000	
伊藤忠テクノソリュー	30,200	3,270.00	98,754,000	
フルキャストホールディングス	38,700	2,145.00	83,011,500	

富士フイルムＨＬＤＧＳ	43,200	8,517.00	367,934,400	
デクセリアルズ	131,000	2,128.00	278,768,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	50,000	2,021.00	101,050,000	
ＡＧＣ	72,600	4,895.00	355,377,000	
ニチアス	52,500	2,800.00	147,000,000	
日本冶金工	24,600	2,846.00	70,011,600	
三菱製鋼	31,200	1,495.00	46,644,000	
大紀アルミニウム	52,700	1,465.00	77,205,500	
三井金属	38,600	3,535.00	136,451,000	
住友電工	94,500	1,498.00	141,561,000	
三和ホールディングス	94,700	1,397.00	132,295,900	
日東精工	80,100	673.00	53,907,300	
マルゼン	32,000	2,371.00	75,872,000	
ファインシンター	19,300	1,790.00	34,547,000	
ソディツク	87,300	992.00	86,601,600	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	73,500	1,567.00	115,174,500	
豊田自動織機	13,600	9,390.00	127,704,000	
フリュー	58,900	1,611.00	94,887,900	
サト－ホールディングス	17,600	2,727.00	47,995,200	
技研製作所	13,900	4,490.00	62,411,000	
クボタ	31,600	2,227.00	70,373,200	
三精テクノロジーズ	29,400	766.00	22,520,400	
キトー	58,600	1,674.00	98,096,400	
日　立	88,500	6,225.00	550,912,500	
富士電機	58,000	4,690.00	272,020,000	
ＥＩＺＯ	13,000	4,265.00	55,445,000	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	11,300	11,740.00	132,662,000	
アドバンテスト	24,400	9,230.00	225,212,000	
デンソー	24,900	7,728.00	192,427,200	
村田製作所	17,700	8,911.00	157,724,700	
ＩＨＩ	70,800	2,574.00	182,239,200	
プレミアグループ	62,400	3,215.00	200,616,000	
いすゞ自動車	178,600	1,494.00	266,828,400	
トヨタ自動車	51,200	9,813.00	502,425,600	
プレス工業	120,000	355.00	42,600,000	
ミクニ	68,400	311.00	21,272,400	
萩原電気ＨＬＤＧＳ	17,900	2,252.00	40,310,800	
コ　ジ　マ	79,600	684.00	54,446,400	
アルゴグラフィックス	32,200	3,110.00	100,142,000	
ダイトロン	56,000	2,178.00	121,968,000	

スター精密	54,300	1,522.00	82,644,600	
リ　コ　ー	139,900	1,109.00	155,149,100	
フジシールインターナショナル	51,100	2,438.00	124,581,800	
大日本印刷	74,300	2,494.00	185,304,200	
藤森工業	10,400	4,165.00	43,316,000	
リンテック	23,200	2,454.00	56,932,800	
信越ポリマー	127,900	994.00	127,132,600	
任　天　堂	1,500	51,940.00	77,910,000	
三井物産	77,700	2,558.50	198,795,450	
東京エレクトロン	6,700	44,930.00	301,031,000	
スターゼン	21,200	2,228.00	47,233,600	
セイコーＨＤ	40,200	2,234.00	89,806,800	
日本ユニシス	50,600	2,887.00	146,082,200	
三菱商事	49,000	3,256.00	159,544,000	
稲畑産業	42,200	1,688.00	71,233,600	
しまむら	14,900	10,500.00	156,450,000	
丸井グループ	37,700	1,912.00	72,082,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	514,500	600.80	309,111,600	
三井住友トラストＨＤ	44,200	3,660.00	161,772,000	
三井住友フィナンシャルＧ	98,700	3,814.00	376,441,800	
ＳＢＩホールディングス	36,900	2,708.00	99,925,200	
オリックス	132,400	2,033.00	269,169,200	
ＭＳ＆ＡＤ	54,000	3,485.00	188,190,000	
第一生命ＨＬＤＧＳ	81,600	2,182.50	178,092,000	
東京海上ＨＤ	68,300	5,340.00	364,722,000	
東京建物	83,400	1,672.00	139,444,800	
山　九	19,400	4,925.00	95,545,000	
丸全昭和運輸	14,300	3,230.00	46,189,000	
センコーグループＨＬＤＧＳ	108,000	1,040.00	112,320,000	
三井倉庫ＨＯＬＤ	56,500	2,616.00	147,804,000	
日本電信電話	81,600	2,888.00	235,660,800	
ＫＤＤＩ	110,600	3,335.00	368,851,000	
シーイーシー	28,400	1,556.00	44,190,400	
日本管財	6,100	2,577.00	15,719,700	
日鉄物産	28,900	5,020.00	145,078,000	
合計			15,364,635,300	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年8月31日

Ⅰ	資産総額	244,605,155円
Ⅱ	負債総額	137,123円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	244,468,032円
Ⅳ	発行済数量	214,389,023口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1403円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2021年8月31日

Ⅰ	資産総額	20,442,403,177円
Ⅱ	負債総額	28,038,683円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,414,364,494円
Ⅳ	発行済数量	10,749,171,127口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8992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8月31日

Ⅰ	資産総額	94,304,778,081円
Ⅱ	負債総額	641,214,588円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,663,563,493円
Ⅳ	発行済数量	27,090,390,646口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4574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8月31日

Ⅰ	**資産総額**	**15,722,389,581円**
Ⅱ	**負債総額**	**2,070,000円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**15,720,319,581円**
Ⅳ	**発行済数量**	**4,770,180,235口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**3.2955円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年8月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．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8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	57	141,552
追加型株式投資信託	753	21,126,069
株式投資信託　　合計	810	21,267,621
単位型公社債投資信託	71	205,616
追加型公社債投資信託	14	1,470,690
公社債投資信託　合計	85	1,676,306
総合計	895	22,943,927

３【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2020年４月１日から2021年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		2,741		4,860
有価証券		22,167		333
前払費用		205		237
未収委託者報酬		10,847		13,150
未収収益		63		49
関係会社短期貸付金		-		18,700
その他		62		207
流動資産計		36,088		37,539
固定資産				
有形固定資産	※1	217	※1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068

繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		69		68
未払金		7,573		8,405
未払収益分配金		14		13
未払償還金		39		39
未払手数料		3,988		4,734
その他未払金	※2	3,530	※2	3,617
未払費用		3,830		3,777
未払法人税等		656		804
未払消費税等		590		631
賞与引当金		688		950
その他		5		88
流動負債計		13,414		14,725
固定負債				
退職給付引当金		2,574		2,452
役員退職慰労引当金		88		74
その他		5		3
固定負債計		2,667		2,530
負債合計		16,082		17,256
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495
利益剰余金				
利益準備金		374		374
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		11,749		10,574

利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△363	947
評価・換算差額等合計	△363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37

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

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

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

当事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

（追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年７月４日）第７-４項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。

ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

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

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2020年３月31日）

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

当事業年度（2021年３月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

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

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。

① 剰余金の配当の総額	9,388百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ １株当たり配当額	3,599円
④ 基準日	2021年３月31日
⑤ 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関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等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おります。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　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す。

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

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

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

当事業年度（自　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㈱	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	㈱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㈱	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す。

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

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

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

(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おりません。

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　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。

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

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

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

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

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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】

	①　名　称	②　資本金の額 (2021年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
投資顧問会社	コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	535千米ﾄﾞﾙ （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充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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ないます。

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2021年3月2日	臨時報告書
2021年5月7日	有価証券届出書、有価証券報告書
2021年5月31日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2021年５月21日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年9月17日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）の2021年2月16日から2021年8月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）の2021年8月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。