【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2022年2月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて、3兆円を上限とし、合計で9兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

（注1）上記の総称を「ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ（愛称：ミルフィーユ）（奇数月分配型）」とします。
（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、3兆円を上限とし、合計で9兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2022年2月4日から2022年8月3日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、内外の公社債、不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざし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〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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。

2. インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の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、「1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

3. 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の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、「1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

（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。

上記1.～3. は、「ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ（愛称：ミルフィーユ）（奇数月分配型）」を構成します。

※各ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

ファンドの名称	略称
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	安定重視ポートフォリオ
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	インカム重視ポートフォリオ
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	成長重視ポートフォリオ

＜信託金の限度額＞

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

＜ファンドの特色＞

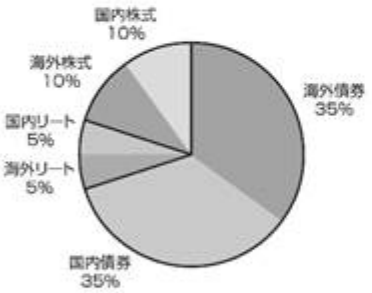
1 内外の債券、リートおよび株式に投資します(注)。

（注）「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」は、「わが国の債券」に投資しません。

資産配分のイメージ

各ファンド（安定重視ポートフォリオ／インカム重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ）における各資産の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処とします。

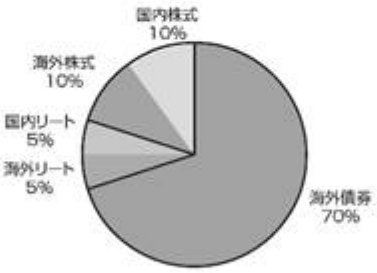
安定重視ポートフォリオ



<標準組入比率>

	海外	国内	合計
債券	35%	35%	70%
リート	5%	5%	10%
株式	10%	10%	20%
合計	50%	50%	100%

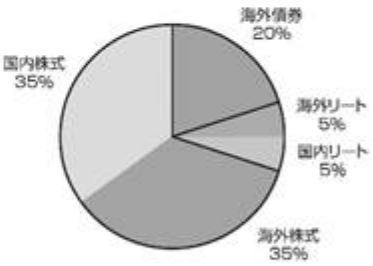
インカム重視ポートフォリオ



<標準組入比率>

	海外	国内	合計
債券	70%	——	70%
リート	5%	5%	10%
株式	10%	10%	20%
合計	85%	15%	100%

成長重視ポートフォリオ



<標準組入比率>

	海外	国内	合計
債券	20%	——	20%
リート	5%	5%	10%
株式	35%	35%	70%
合計	60%	40%	100%

※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。
※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

（注1）「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「ダイワ日本国債マザーファンド」を除きます。
（注2）「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「わが国の国債」を除きます。

2 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度　欧州通貨圏：50%程度

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

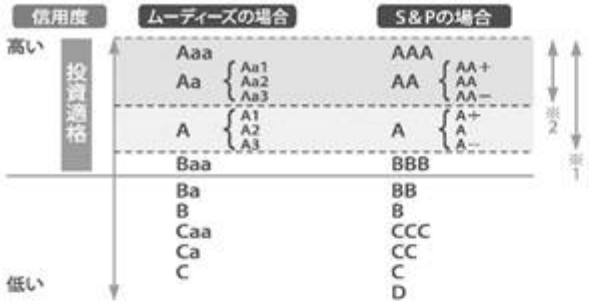
※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて



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

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

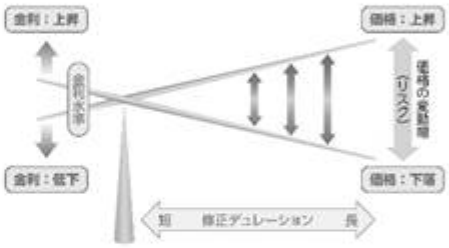
●ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

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

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

金利変動と修正デュレーションの関係（イメージ）

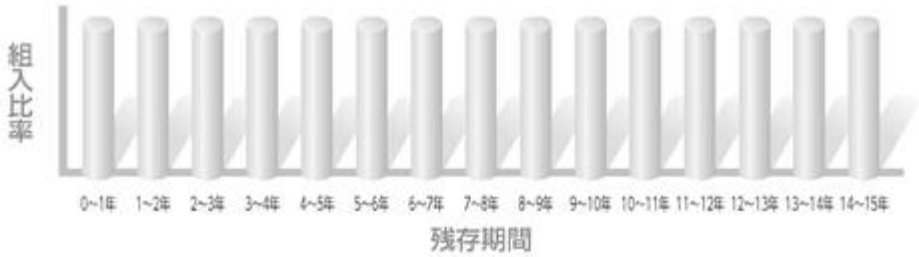


●金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

3　わが国の国債への投資にあたっては、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

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

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

海外のリートの投資対象地域（イメージ）

投資対象銘柄の業種（イメージ）

※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

●北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成（イメージ）

投資対象のイメージ

◆北米の株式の運用は、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。

ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・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。

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

※ハイブリッド優先証券とは…
- 株式と債券の両方の性質を併せ持った証券です。
- 弁済順位は、株式と債券の中間の位置付けとなります。

〈 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて 〉

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

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

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

〈 アムンディ・アイルランド・リミテッドについて 〉

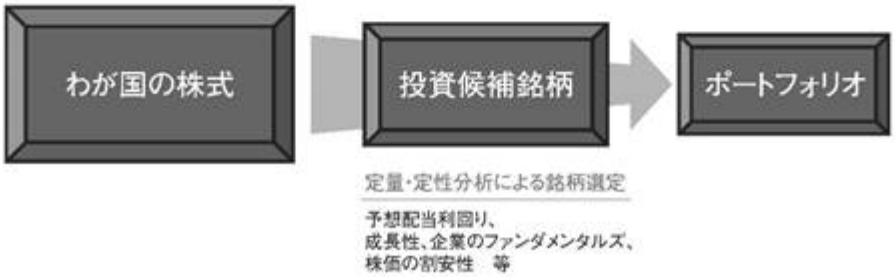
アムンディ・アイルランド・リミテッドは、運用資産額で欧州および世界でトップクラスに入るフランスの資産運用会社アムンディ・グループの主要運用拠点のひとつで、アイルランド（ダブリン市）に所在します。

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

投資対象のイメージ

※配当利回り：株式投資を行なう際に用いられる株式の投資価値を測る指標のひとつです。個別銘柄の配当利回りから株価の割安度の測定や、株式市場全体の配当利回りと市場金利を比較して、株価水準の妥当性の測定などを行なうことができます。
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.～6.の運用が行なわれないことがあります。

7 毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11月）の各10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

[安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ]

●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。

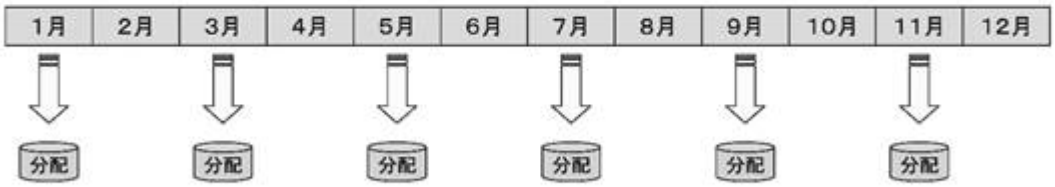
●原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

[インカム重視ポートフォリオ]

●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、配当等収益等を中心に継続した分配を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。）等を中心に分配を行ないます。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



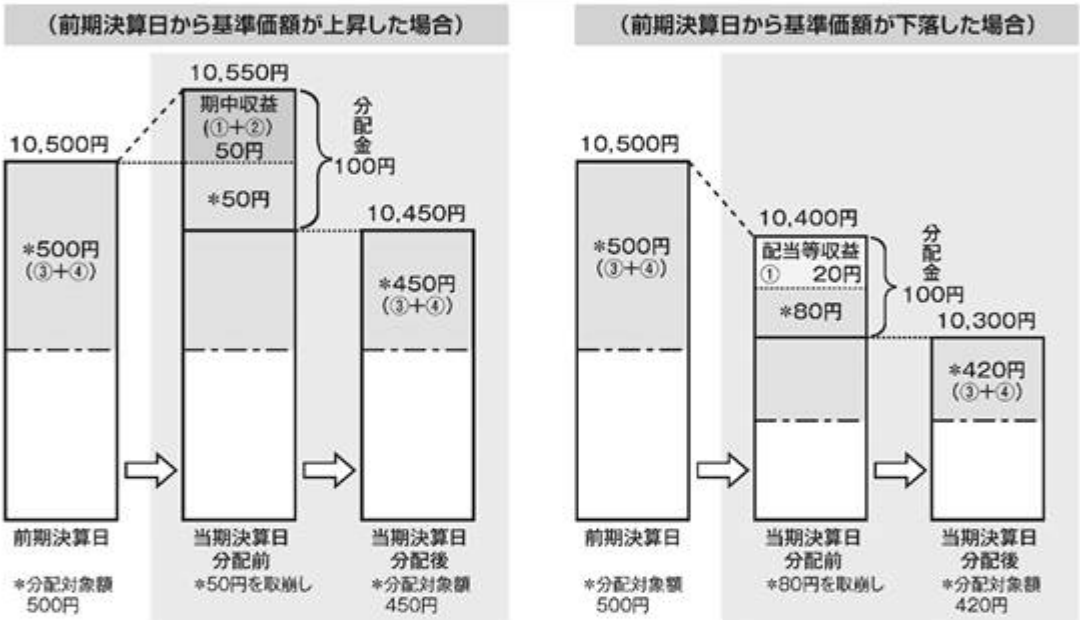
- 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

［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。

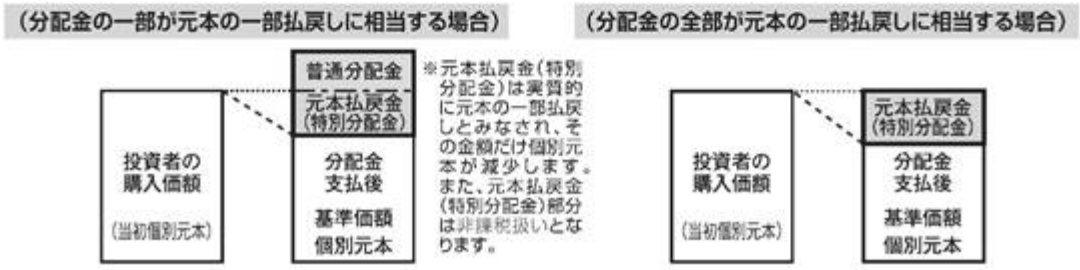
（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



（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。



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11月14日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注1）、償還金など↑↓お申込金(※5)

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

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※5)

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

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金(※5)

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

損益↑↓投資

投資対象	内外の公社債、不動産投資信託証券および株式　など ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。 ・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド（コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）

（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、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（※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11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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券（安定重視ポートフォリオのみ）
3. ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの受益証券
4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

② 投資態度

＜安定重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率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35%
ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の35%
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5%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
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10%

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

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

＜インカム重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざします。

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70%
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5%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の3.3%
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10%

ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

＜成長重視ポートフォリオ＞

イ．主として、マザーファンドを通じて海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の成長をめざします。

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20%

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5%

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の5%

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の11.6%

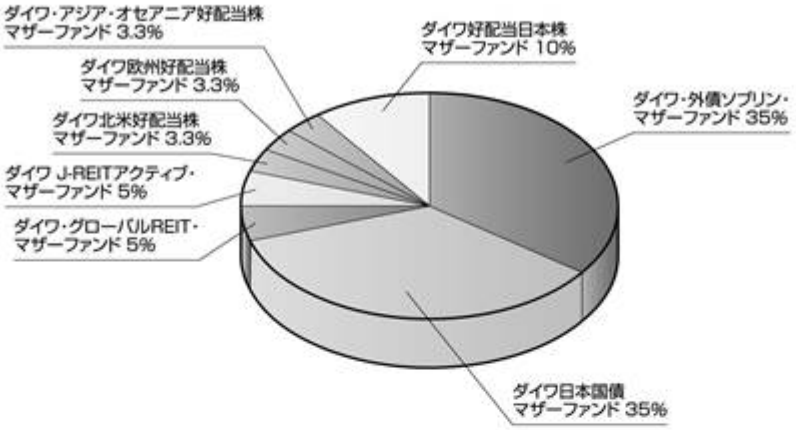
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の35%

ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

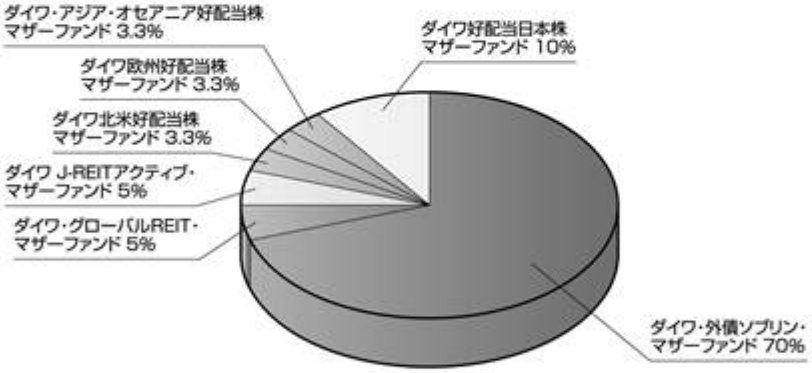
〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

各ファンド(安定重視ポートフォリオ／インカム重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ)における各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。
ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

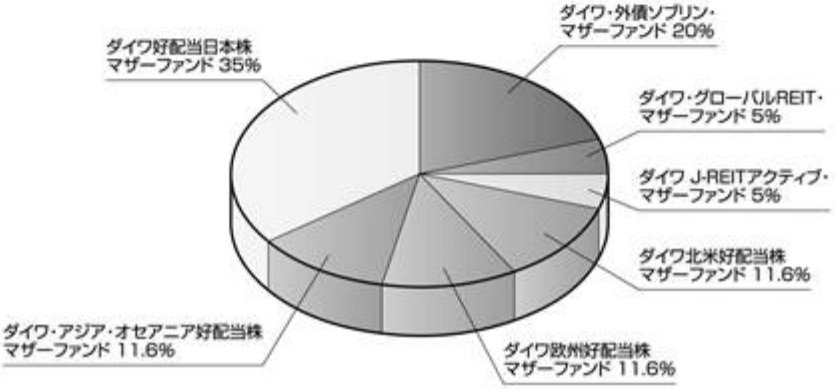
〈安定重視ポートフォリオ〉



〈インカム重視ポートフォリオ〉



〈成長重視ポートフォリオ〉



(2)【投資対象】

＜各ファンド共通＞

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

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

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

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

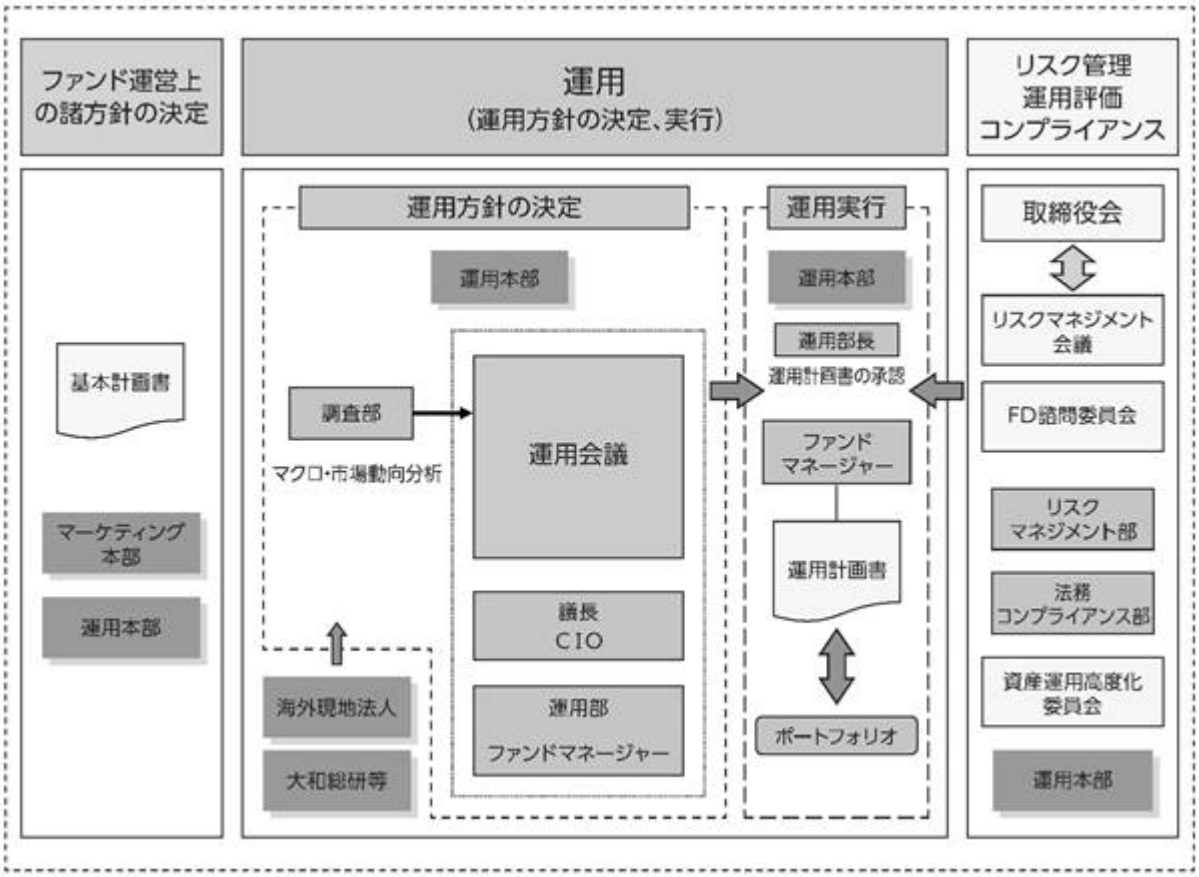
③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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。

へ．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45～55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。

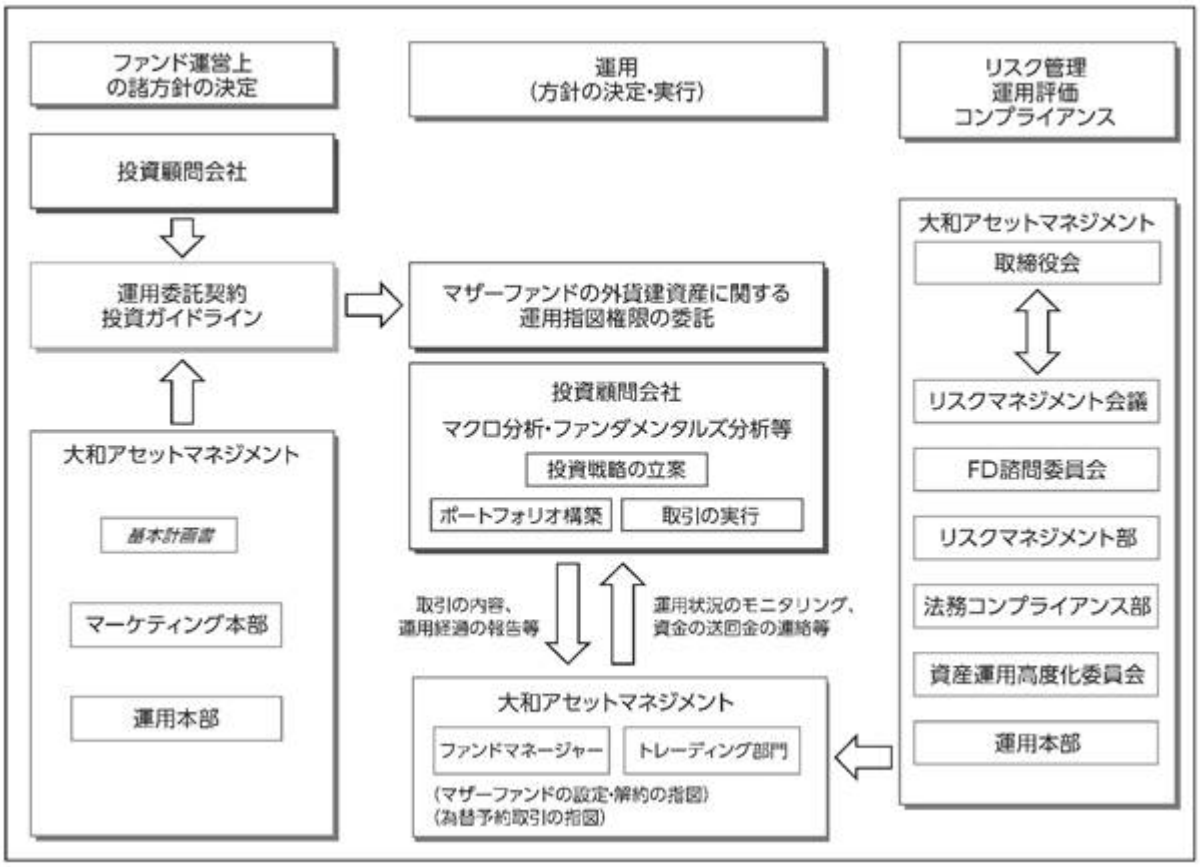
ハ．資産運用高度化委員会

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、海外（北米）株式および海外（欧州）株式にかかる運用体制について
（マザーファンドにかかるものを含みます。）



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

（前④に同じ。）

※　上記の運用体制は2021年11月30日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

＜安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ＞

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

② 原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して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。

＜インカム重視ポートフォリオ＞

① （安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオと同規定）

② 原則として、配当等収益等を中心に継続した分配を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。）等を中心に分配を行ないます。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計算期末には、収益の分配は行ないません。

③ （安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオと同規定）

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

① 株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

② 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤ 信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑥ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式への投資は、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　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2．ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

2.　（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

2.～16.　（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

③　（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

①　（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

②　（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

③　外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

イ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ.と同規定）

⑤　スワップ取引

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

ロ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

ホ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

⑥　金利先渡取引

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

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

ハ．（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

3．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

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

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

4. ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
3. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
4. 新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限ります。）
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

④ 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 先物取引

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

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

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

5．ダイワ北米好配当株マザーファンド
6．ダイワ欧州好配当株マザーファンド
7．ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

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

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

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

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

(2) 投資対象

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞
＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞
①　（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
②　委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1.～11.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの
なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
③　（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限
＜各ファンド共通＞
①　株式への投資割合には、制限を設けません。
②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
③　先物取引等
イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
1. 先物取引の売建およびコール・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. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならび

に前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

1. 先物取引の売建およびコール・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. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

④　スワップ取引

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。

⑤　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。

(4) 運用指図権限の委託

＜ダイワ北米好配当株マザーファンド＞

①　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

②　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ欧州好配当株マザーファンド＞

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。

アムンディ・アイルランド・リミテッド
１ ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

②　（ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドと同規定）

＜ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド＞

該当事項はありません。

8．ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

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)③、④および⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証書

2.～10. （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12.～20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

③ （ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

③　先物取引等

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

1. 先物取引の売建およびコール・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。

④　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。

⑤　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、ハイブリッド優先証券、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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　ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

また、ハイブリッド優先証券の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、大きく下落します。こ

の際、ハイブリッド優先証券は一般の債券に比し、弁済順位が劣後するため、影響がより大きくなる可能性があります。

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

③　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。

④　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。

⑤　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

⑥　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。

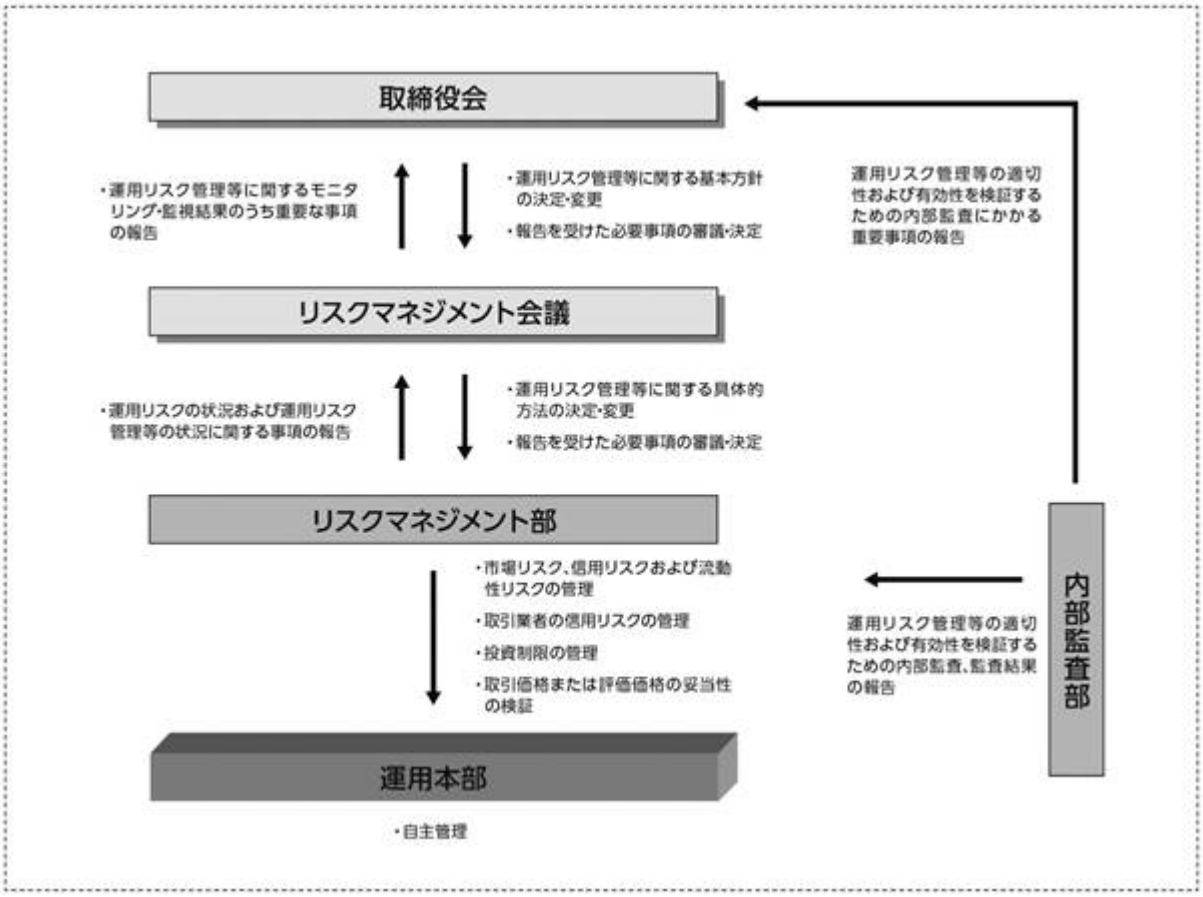
※　流動性リスクに関する事項

・　当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(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

・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

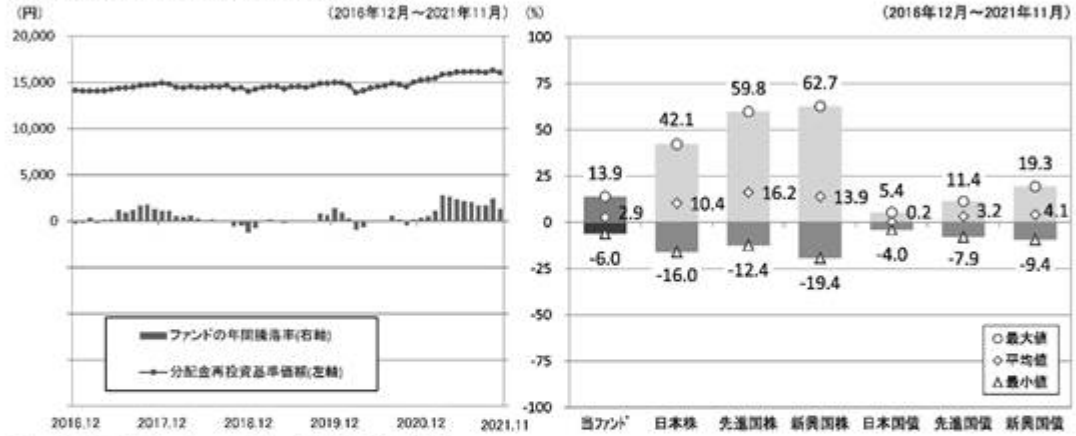
参　考　情　報

●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。

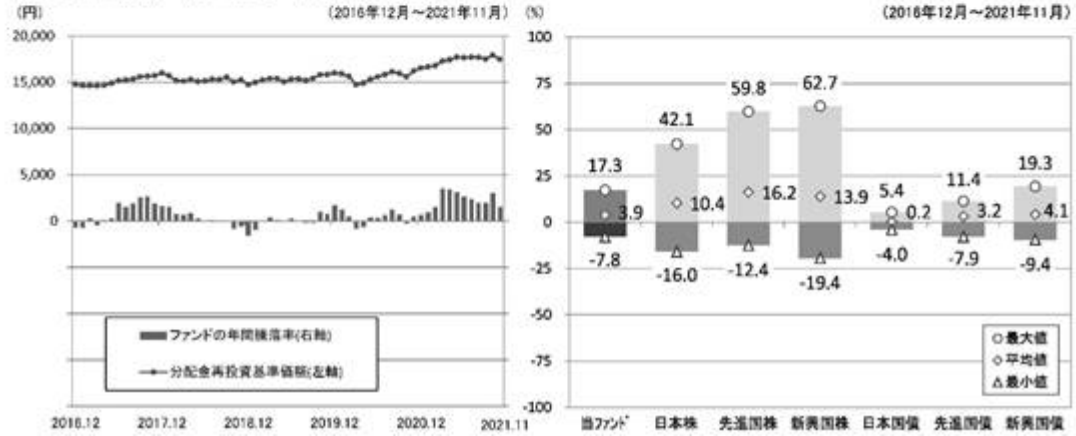
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

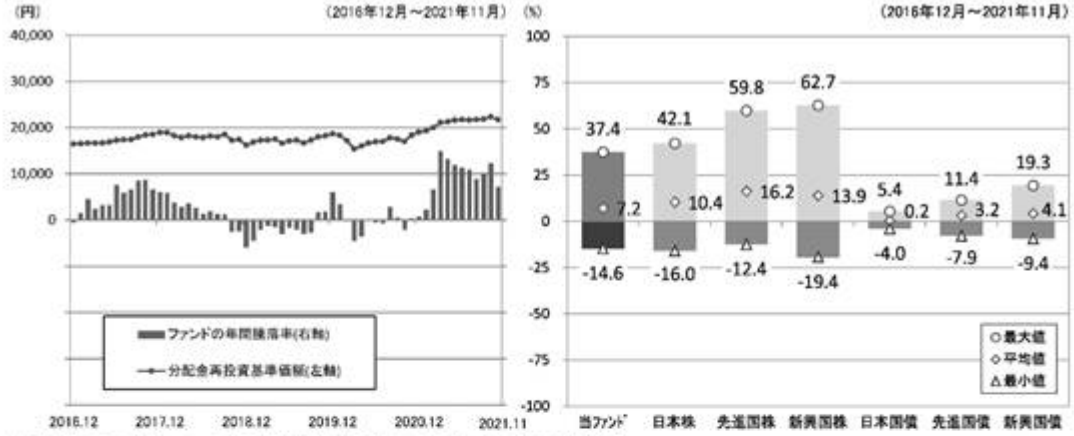
［安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



［インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



［成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）］



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

安定重視ポートフォリオ	年率1.32%（税抜1.20%）
インカム重視ポートフォリオ	年率1.4025%（税抜1.275%）
成長重視ポートフォリオ	年率1.485%（税抜1.35%）

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

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

イ．安定重視ポートフォリオ

	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
100億円以下の部分	年率1.20%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.60%（税抜）	年率0.05%（税抜）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.65%（税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.70%（税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.80%（税抜）	

ロ．インカム重視ポートフォリオ

	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
100億円以下の部分	年率1.275%（税抜）から販売会社、受託会社分を除いた額	年率0.65%（税抜）	年率0.05%（税抜）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.70%（税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.80%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.85%（税抜）	

ハ．成長重視ポートフォリオ

	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

100億円以下の部分	年率1.35%（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）
100億円超 200億円以下の部分		年率0.75%（税抜）	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.80%（税抜）	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.85%（税抜）	
1,000億円超の部分		年率0.90%（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」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

イ．ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に年率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。

ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。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（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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11月30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】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】 (2021年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		676,768,711	99.14
	内 日本	676,768,711	99.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,845,419	0.86
純資産総額		682,614,130	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11月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	191,482,469	1.2630 241,861,506	1.2633 241,899,803	35.44
2	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	126,783,193	1.9036 241,344,486	1.8731 237,477,598	34.79
3	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	19,555,722	3.4479 67,426,174	3.3200 64,924,997	9.51
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,420,536	3.6172 34,075,962	3.6135 34,041,106	4.99
5	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,630,556	3.5243 33,940,968	3.4407 33,135,854	4.85
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,037,046	4.3794 22,059,239	4.3821 22,072,839	3.23

7	ダイワ･アジア･オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,882,565	2.8446 22,422,744	2.7809 21,920,625	3.21
8	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,479,745	2.1352 22,376,351	2.0321 21,295,889	3.12

(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	99.14%
合計	99.14%

(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5月10日)	2,560,967,176	2,584,608,951	0.7583	0.7653
第14特定期間末 (2012年11月12日)	2,292,447,787	2,313,809,883	0.7512	0.7582
第15特定期間末 (2013年5月10日)	2,142,721,022	2,154,379,012	0.9190	0.9240
第16特定期間末 (2013年11月11日)	1,828,381,467	1,838,763,868	0.8805	0.8855
第17特定期間末 (2014年5月12日)	1,599,035,793	1,607,888,426	0.9031	0.9081

第18特定期間末 (2014年11月10日)	1,564,939,411	1,573,080,464	0.9611	0.9661
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,466,139,398	1,473,605,263	0.9819	0.9869
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,332,286,357	1,339,328,742	0.9459	0.9509
第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,275,810,635	1,280,763,009	0.9017	0.9052
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,158,313,348	1,162,998,429	0.8653	0.8688
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,123,093,842	1,126,188,676	0.9072	0.9097
第24特定期間末 (2017年11月10日)	1,034,788,125	1,036,447,975	0.9351	0.9366
第25特定期間末 (2018年5月10日)	967,647,840	969,234,113	0.9150	0.9165
第26特定期間末 (2018年11月12日)	893,566,366	895,052,636	0.9018	0.9033
第27特定期間末 (2019年5月10日)	872,820,093	874,284,036	0.8943	0.8958
第28特定期間末 (2019年11月11日)	832,937,076	834,300,311	0.9165	0.9180
第29特定期間末 (2020年5月11日)	725,646,190	726,897,697	0.8697	0.8712
第30特定期間末 (2020年11月10日)	698,324,933	699,468,589	0.9159	0.9174
2020年11月末日	700,207,791	―	0.9208	―
12月末日	736,291,144	―	0.9349	―
2021年1月末日	725,017,597	―	0.9390	―
2月末日	706,929,313	―	0.9459	―
3月末日	707,411,343	―	0.9679	―
4月末日	711,613,416	―	0.9744	―
第31特定期間末 (2021年5月10日)	714,859,638	715,954,396	0.9795	0.9810
5月末日	707,809,883	―	0.9830	―
6月末日	706,731,796	―	0.9840	―
7月末日	705,292,150	―	0.9841	―
8月末日	706,341,203	―	0.9843	―
9月末日	695,610,353	―	0.9767	―

10月末日	699,557,508	―	0.9916	―
第32特定期間末 (2021年11月10日)	695,561,498	696,618,226	0.9873	0.9888
11月末日	682,614,130	―	0.9742	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第13特定期間	0.0210
第14特定期間	0.0210
第15特定期間	0.0170
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0150
第19特定期間	0.0150
第20特定期間	0.0150
第21特定期間	0.0135
第22特定期間	0.0105
第23特定期間	0.0075
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第13特定期間	4.7
第14特定期間	1.8
第15特定期間	24.6
第16特定期間	△2.6
第17特定期間	4.3
第18特定期間	8.1
第19特定期間	3.7
第20特定期間	△2.1
第21特定期間	△3.2

第22特定期間	△2.9
第23特定期間	5.7
第24特定期間	3.6
第25特定期間	△1.7
第26特定期間	△1.0
第27特定期間	△0.3
第28特定期間	3.0
第29特定期間	△4.6
第30特定期間	5.8
第31特定期間	7.4
第32特定期間	1.3

(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	25,669,129	424,600,240
第14特定期間	17,944,954	343,613,359
第15特定期間	29,124,357	749,254,227
第16特定期間	67,499,016	322,616,895
第17特定期間	20,512,498	326,466,069
第18特定期間	36,554,030	178,870,138
第19特定期間	30,337,306	165,374,860
第20特定期間	28,106,161	112,802,115
第21特定期間	74,111,919	67,624,842
第22特定期間	25,510,906	101,880,470
第23特定期間	16,442,452	117,103,386
第24特定期間	50,120,711	181,487,643
第25特定期間	19,575,536	68,626,578
第26特定期間	31,692,198	98,360,995
第27特定期間	48,286,397	63,170,843
第28特定期間	8,617,791	75,756,294
第29特定期間	11,410,328	85,896,293
第30特定期間	10,881,980	82,782,003
第31特定期間	61,263,599	93,862,473
第32特定期間	30,258,792	55,612,312

（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11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		18,262,567,497	93.09
	内 ユーロ	4,798,979,487	24.46
	内 ノルウェー	262,013,102	1.34
	内 スウェーデン	363,946,238	1.86
	内 デンマーク	552,102,247	2.81
	内 イギリス	2,426,717,856	12.37
	内 ポーランド	1,068,086,372	5.44
	内 カナダ	1,622,729,045	8.27
	内 アメリカ	4,741,192,877	24.17
	内 オーストラリア	2,426,800,273	12.37
特殊債券		978,070,712	4.99
	内 カナダ	978,070,712	4.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		378,268,107	1.93
純資産総額		19,618,906,316	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）		266,855,295	1.36
	内 日本	266,855,295	1.36
為替予約取引（売建）		269,808,000	△1.38
	内 日本	269,808,000	△1.38

(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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	27,183,400	94.24 2,914,580,318	94.91 2,935,455,742	0.875000 2030/11/15	14.96

2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	19,000,000	129.43 1,999,198,298	127.97 1,976,540,337	4.500000 2033/04/21	10.07
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	13,998,800	105.94 1,687,246,498	105.28 1,676,878,389	2.250000 2027/08/15	8.55
4	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,136,000	109.14 1,280,485,597	109.07 1,279,629,195	1.400000 2028/04/30	6.52
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,660,000	110.28 1,226,369,586	110.00 1,223,278,141	1.950000 2026/04/30	6.24
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,750,400	154.47 942,265,245	159.24 971,368,290	3.250000 2045/05/25	4.95
7	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	11,046,000	90.87 896,006,425	91.03 897,544,532	0.500000 2030/12/01	4.57
8	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,830,000	104.02 727,022,780	102.71 717,846,147	2.250000 2025/12/15	3.66
9	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,320,000	103.83 679,848,448	104.33 683,089,407	1.500000 2026/07/22	3.48
10	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	25,000,000	104.08 714,689,244	97.35 668,478,372	2.750000 2028/04/25	3.41
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,015,900	114.83 524,880,791	114.52 523,468,384	5.000000 2025/03/07	2.67
12	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	105.07 509,624,743	106.63 517,171,219	1.625000 2028/10/22	2.64
13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,095,700	91.79 430,697,103	94.45 443,168,022	0.250000 2031/07/31	2.26
14	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,872,000	106.75 393,712,898	106.64 393,314,601	1.000000 2026/05/15	2.00
15	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	20,200,000	109.09 380,564,828	109.01 380,306,676	1.750000 2025/11/15	1.94
16	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	4,153,000	101.63 376,761,379	100.61 372,965,444	1.500000 2026/06/01	1.90
17	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	108.92 333,942,762	108.73 333,381,699	1.100000 2029/05/15	1.70

18	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	164.32 316,508,820	168.94 325,415,337	3.750000 2045/06/22	1.66
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	113.79 268,256,756	111.72 263,372,202	3.250000 2029/04/21	1.34
20	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	104.36 263,208,530	103.89 262,013,102	3.000000 2024/03/14	1.34
21	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,815,000	104.92 263,644,307	103.56 260,224,564	2.550000 2025/03/15	1.33
22	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	157.20 238,255,351	171.43 259,820,823	4.250000 2046/12/07	1.32
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,000,000	91.42 200,883,398	85.55 187,983,355	1.250000 2030/10/25	0.96
24	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	105.01 187,243,740	104.98 187,184,900	1.000000 2026/11/12	0.95
25	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	1,957,000	120.11 191,090,746	117.47 186,887,733	4.750000 2027/04/21	0.95
26	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,700,000	115.56 175,356,090	117.18 177,811,275	2.750000 2048/12/01	0.91
27	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	103.79 177,260,025	103.50 176,761,336	1.500000 2023/11/13	0.90
28	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	127.84 171,175,687	130.26 174,407,791	3.500000 2045/12/01	0.89
29	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	5,500,000	173.75 165,044,036	180.86 171,795,570	4.500000 2039/11/15	0.88
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,000,000	97.02 159,890,990	92.65 152,689,510	0.750000 2025/04/25	0.78

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	93.09%
特殊債券	4.99%

合計	98.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年12月	買建	1,122,371	128,910,000	127,602,393	0.65%
		豪ドル買/円売 2021年12月	買建	1,713,460	141,801,000	139,252,902	0.71%
		ユーロ売/円買 2021年12月	売建	2,100,000	270,711,000	269,808,000	△1.38%

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

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

(注3)　為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		147,160,879,670	99.07
	内　日本	147,160,879,670	99.07
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		1,386,598,458	0.93
純資産総額		148,547,478,128	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	54 20年国債	日本	国債証券	5,987,000,000	101.80 6,094,850,000	100.12 5,994,184,400	2.200000 2021/12/20	4.04
2	24 30年国債	日本	国債証券	4,200,000,000	133.29 5,598,432,000	132.49 5,564,790,000	2.500000 2036/09/20	3.75
3	12 30年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	122.92 5,531,400,000	122.90 5,530,500,000	2.100000 2033/09/20	3.72
4	20 30年国債	日本	国債証券	4,200,000,000	130.99 5,501,580,000	130.98 5,501,202,000	2.500000 2035/09/20	3.70
5	88 20年国債	日本	国債証券	4,860,000,000	112.46 5,465,650,000	110.99 5,394,405,600	2.300000 2026/06/20	3.63
6	80 20年国債	日本	国債証券	4,973,000,000	109.36 5,438,744,150	107.89 5,365,717,810	2.100000 2025/06/20	3.61
7	70 20年国債	日本	国債証券	5,038,000,000	108.09 5,446,077,400	106.46 5,363,505,180	2.400000 2024/06/20	3.61
8	16 30年国債	日本	国債証券	4,100,000,000	129.44 5,307,040,000	129.27 5,300,275,000	2.500000 2034/09/20	3.57
9	59 20年国債	日本	国債証券	5,195,000,000	103.22 5,362,399,000	101.91 5,294,588,150	1.700000 2022/12/20	3.56
10	140 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	117.10 5,269,500,000	117.16 5,272,290,000	1.700000 2032/09/20	3.55
11	130 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	117.16 5,272,335,000	117.07 5,268,195,000	1.800000 2031/09/20	3.55
12	121 20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	117.14 5,271,596,000	116.87 5,259,555,000	1.900000 2030/09/20	3.54
13	95 20年国債	日本	国債証券	4,605,000,000	114.65 5,279,638,500	113.36 5,220,412,200	2.300000 2027/06/20	3.51
14	1 30年国債	日本	国債証券	4,150,000,000	123.19 5,112,448,000	122.37 5,078,438,000	2.800000 2029/09/20	3.42
15	102 20年国債	日本	国債証券	4,200,000,000	117.41 4,931,604,000	116.33 4,885,902,000	2.400000 2028/06/20	3.29
16	101 20年国債	日本	国債証券	4,160,000,000	116.94 4,864,704,000	115.73 4,814,617,600	2.400000 2028/03/20	3.24
17	75 20年国債	日本	国債証券	4,274,000,000	108.84 4,651,851,600	107.35 4,588,224,480	2.100000 2025/03/20	3.09

18	68 20年国債	日本	国債証券	4,325,000,000	107.01 4,628,182,500	105.34 4,556,257,750	2.200000 2024/03/20	3.07
19	145 20年国債	日本	国債証券	3,800,000,000	117.76 4,474,880,000	117.93 4,481,454,000	1.700000 2033/06/20	3.02
20	19 30年国債	日本	国債証券	3,500,000,000	127.81 4,473,350,000	127.87 4,475,590,000	2.300000 2035/06/20	3.01
21	86 20年国債	日本	国債証券	4,000,000,000	111.92 4,476,880,000	110.40 4,416,320,000	2.300000 2026/03/20	2.97
22	15 30年国債	日本	国債証券	3,400,000,000	128.99 4,385,660,000	128.79 4,378,860,000	2.500000 2034/06/20	2.95
23	23 30年国債	日本	国債証券	3,300,000,000	132.92 4,386,591,000	132.05 4,357,749,000	2.500000 2036/06/20	2.93
24	94 20年国債	日本	国債証券	3,900,000,000	112.88 4,402,518,000	111.71 4,357,041,000	2.100000 2027/03/20	2.93
25	63 20年国債	日本	国債証券	4,200,000,000	104.35 4,383,078,000	102.99 4,325,580,000	1.800000 2023/06/20	2.91
26	134 20年国債	日本	国債証券	3,500,000,000	117.37 4,108,205,000	117.62 4,116,980,000	1.800000 2032/03/20	2.77
27	116 20年国債	日本	国債証券	3,200,000,000	119.04 3,809,280,000	118.70 3,798,400,000	2.200000 2030/03/20	2.56
28	56 20年国債	日本	国債証券	3,700,000,000	102.69 3,799,530,000	101.17 3,743,327,000	2.000000 2022/06/20	2.52
29	111 20年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	118.01 2,950,270,000	117.23 2,930,775,000	2.200000 2029/06/20	1.97
30	125 20年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	120.93 2,418,640,000	120.23 2,404,660,000	2.200000 2031/03/20	1.62

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.07%
合計	99.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		94,749,468,684	93.49
	内 ガーンジィ	429,169,942	0.42
	内 香港	2,749,291,167	2.71
	内 シンガポール	6,917,710,833	6.83
	内 イギリス	9,795,807,570	9.67
	内 オランダ	1,041,158,572	1.03
	内 ベルギー	3,906,526,022	3.85
	内 フランス	3,909,485,228	3.86
	内 ドイツ	638,408,938	0.63
	内 スペイン	1,163,412,825	1.15
	内 カナダ	1,669,871,239	1.65
	内 アメリカ	47,995,804,352	47.36
	内 オーストラリア	13,729,463,222	13.55
	内 ニュージーランド	803,358,774	0.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,599,072,381	6.51
純資産総額		101,348,541,065	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)

1	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,126,245	1,828.53 3,887,937,292	1,995.66 4,243,282,296	4.19
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	195,072	14,775.08 2,882,225,028	18,196.37 3,549,603,030	3.50
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	93,505	36,122.88 3,377,674,609	37,759.12 3,530,667,011	3.48
4	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	501,109	5,761.19 2,887,005,356	6,763.62 3,389,314,112	3.34
5	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,183,872	1,430.13 3,123,380,088	1,542.07 3,367,686,334	3.32
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	328,807	9,894.80 3,253,516,232	9,333.69 3,068,982,871	3.03
7	LINK REIT	香港	投資証券	2,742,892	1,008.16 2,765,298,685	1,002.33 2,749,291,167	2.71
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	325,590	7,512.00 2,445,858,982	7,941.14 2,585,557,726	2.55
9	UDR INC	アメリカ	投資証券	382,378	6,085.89 2,327,122,354	6,538.36 2,500,125,747	2.47
10	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	137,319	15,101.71 2,073,755,944	17,438.66 2,394,660,122	2.36
11	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,091,812	1,937.69 2,115,626,767	2,148.36 2,345,608,504	2.31
12	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	566,458	4,021.65 2,278,158,930	3,875.00 2,195,028,262	2.17
13	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	23,487	94,928.89 2,229,595,552	93,291.40 2,191,135,112	2.16
14	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,991,877	394.66 1,970,202,361	416.05 2,076,870,426	2.05
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	50,517	36,913.81 1,864,775,152	39,421.30 1,991,446,065	1.96
16	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	11,041,332	168.16 1,856,835,495	178.06 1,966,123,364	1.94
17	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証券	5,348,035	348.28 1,863,150,595	362.83 1,940,452,354	1.91
18	DEXUS/AU	オーストラリア	投資証券	2,180,303	875.24 1,908,353,987	881.99 1,923,019,615	1.90
19	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	565,239	3,402.86 1,923,430,568	3,200.35 1,808,962,690	1.78
20	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	375,221	4,593.80 1,723,704,410	4,695.28 1,761,770,621	1.74

21	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	926,364	1,893.01 1,753,715,213	1,868.10 1,730,543,738	1.71
22	KLEPIERRE	フランス	投資証券	704,489	2,470.60 1,740,516,441	2,446.85 1,723,780,705	1.70
23	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	88,991	17,556.30 1,562,358,843	19,203.23 1,708,915,380	1.69
24	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	カナダ	投資証券	845,748	2,012.81 1,702,332,569	1,974.43 1,669,871,239	1.65
25	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	7,031,208	246.95 1,737,186,919	235.74 1,657,544,005	1.64
26	WAREHOUSES DE PAUW SCA	ベルギー	投資証券	282,418	4,874.44 1,376,630,613	5,293.06 1,494,855,476	1.47
27	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	63,980	20,883.62 1,336,134,084	23,100.99 1,478,001,884	1.46
28	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	61,702	22,206.65 1,370,199,230	22,384.24 1,381,152,839	1.36
29	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	シンガポール	投資証券	10,908,100	123.31 1,345,411,940	123.15 1,343,341,241	1.33
30	SAFESTORE HOLDINGS PLC	イギリス	投資証券	653,508	1,700.80 1,111,547,061	2,030.90 1,327,212,011	1.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	93.49%
合計	93.49%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		122,508,574,700	97.49
	内 日本	122,508,574,700	97.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,152,766,687	2.51
純資産総額		125,661,341,387	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		2,403,000,000	1.91
	内 日本	2,403,000,000	1.91

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

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

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

(2) 投資資産（2021年11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	13,249	712,801.88 9,443,912,221	700,000.00 9,274,300,000	7.38
2	ＧＬＰ投資法人	日本	投資証券	42,875	184,312.37 7,902,393,057	180,300.00 7,730,362,500	6.15
3	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	11,596	681,000.00 7,896,876,000	655,000.00 7,595,380,000	6.04
4	野村不動産マスターＦ	日本	投資証券	39,777	166,646.86 6,628,712,214	161,400.00 6,420,007,800	5.11
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	61,191	101,434.84 6,206,899,602	97,800.00 5,984,479,800	4.76

6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	16,035	371,634.16 5,959,153,801	369,500.00 5,924,932,500	4.72
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	17,444	324,975.17 5,668,866,891	323,500.00 5,643,134,000	4.49
8	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	29,904	142,462.55 4,260,200,270	144,600.00 4,324,118,400	3.44
9	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,780	155,596.99 4,322,484,610	150,400.00 4,178,112,000	3.32
10	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	20,237	190,695.02 3,859,095,311	187,200.00 3,788,366,400	3.01
11	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	7,984	480,001.94 3,832,335,499	473,000.00 3,776,432,000	3.01
12	オリックス不動産投資	日本	投資証券	19,155	181,800.00 3,482,379,000	180,500.00 3,457,477,500	2.75
13	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	5,199	634,000.00 3,296,166,000	620,000.00 3,223,380,000	2.57
14	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	15,527	216,260.60 3,357,878,473	206,100.00 3,200,114,700	2.55
15	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	4,597	709,154.36 3,259,982,637	689,000.00 3,167,333,000	2.52
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	34,063	85,304.17 2,905,716,001	82,500.00 2,810,197,500	2.24
17	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	7,888	360,842.48 2,846,325,518	348,500.00 2,748,968,000	2.19
18	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,643	588,055.36 2,730,341,070	583,000.00 2,706,869,000	2.15
19	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	8,313	324,522.53 2,697,755,820	319,000.00 2,651,847,000	2.11
20	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	5,874	454,307.39 2,668,601,632	432,000.00 2,537,568,000	2.02
21	産業ファンド	日本	投資証券	12,343	207,200.00 2,557,469,600	202,800.00 2,503,160,400	1.99
22	イオンリート投資	日本	投資証券	16,173	154,596.75 2,500,293,357	152,000.00 2,458,296,000	1.96
23	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,581	415,052.88 2,316,410,127	404,500.00 2,257,514,500	1.80
24	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	59,306	43,153.10 2,559,238,057	38,050.00 2,256,593,300	1.80
25	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	12,590	171,053.33 2,153,561,466	166,700.00 2,098,753,000	1.67

26	日本リート投資法人	日本	投資証券	4,244	428,452.47 1,818,352,325	421,500.00 1,788,846,000	1.42
27	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	5,581	331,002.75 1,847,326,376	314,000.00 1,752,434,000	1.39
28	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,283	510,000.00 1,674,330,000	497,000.00 1,631,651,000	1.30
29	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,210	732,000.00 1,617,720,000	714,000.00 1,577,940,000	1.26
30	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	26,187	66,200.51 1,733,592,937	58,600.00 1,534,558,200	1.22

(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	97.49%
合計	97.49%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	日本	ＴＲＥＩＴ先物　０３１２月	買建	1,200	2,465,400,000	2,403,000,000	1.91%

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

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		3,209,118,805	77.86
	内 カナダ	62,967,371	1.53
	内 アメリカ	3,146,151,434	76.33
ハイブリッド優先証券		677,228,384	16.43
	内 アメリカ	677,228,384	16.43
投資証券		23,747,183	0.58
	内 アメリカ	23,747,183	0.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		211,572,962	5.13
純資産総額		4,121,667,334	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,501	35,091.78 193,040,240	38,298.39 210,679,471	5.11
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	10,250	16,454.89 168,662,803	18,230.50 186,862,674	4.53
3	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	12,133	7,828.96 94,989,385	9,800.14 118,905,193	2.88
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	259	376,745.37 97,577,077	405,199.81 104,946,753	2.55
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	2,667	37,871.07 101,002,359	38,457.67 102,566,614	2.49
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,501	58,076.51 87,172,880	64,204.96 96,371,648	2.34
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,739	18,597.98 88,135,836	18,343.13 86,928,127	2.11

8	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,059	70,625.45 74,792,371	78,215.73 82,830,466	2.01
9	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	12,153	5,906.93 71,787,022	5,877.35 71,427,534	1.73
10	MOTOROLA SOLUTIONS INC	アメリカ	株式	情報技術	2,201	28,373.21 62,449,527	29,523.31 64,980,816	1.58
11	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	アメリカ	株式	生活必需品	8,574	7,294.81 62,546,086	7,373.43 63,219,821	1.53
12	RENEWABLE ENERGY GROUP INC	アメリカ	株式	エネルギー	11,404	6,100.91 69,575,560	5,533.77 63,107,145	1.53
13	NORFOLK SOUTHERN CORP	アメリカ	株式	資本財･サービス	1,990	30,780.47 61,253,245	30,574.54 60,843,354	1.48
14	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	9,943	4,740.79 47,137,734	5,961.54 59,275,672	1.44
15	DOW INC	アメリカ	株式	素材	9,163	6,682.84 61,234,953	6,468.96 59,275,101	1.44
16	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	760	65,685.10 49,920,683	73,810.56 56,096,028	1.36
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	10,671	5,127.61 54,716,768	5,186.77 55,348,069	1.34
18	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,977	18,215.71 54,228,183	18,174.75 54,106,253	1.31
19	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財･サービス	2,275	21,777.85 49,544,616	23,281.89 52,966,306	1.29
20	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,372	24,740.42 33,943,862	37,971.87 52,097,413	1.26
21	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,434	14,647.88 50,300,846	15,006.26 51,531,507	1.25
22	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財･サービス	2,509	18,154.27 45,549,086	19,042.82 47,778,442	1.16
23	TYSON FOODS INC-CL A	アメリカ	株式	生活必需品	5,086	9,067.46 46,117,147	9,315.48 47,378,570	1.15
24	SUNCOR ENERGY INC	カナダ	株式	エネルギー	16,522	2,586.30 42,731,726	2,851.85 47,118,381	1.14

25	ESSENTIAL UTILITIES INC	アメリカ	株式	公益事業	8,385	5,361.98 44,960,203	5,511.01 46,209,893	1.12
26	WASTE MANAGEMENT INC	アメリカ	株式	資本財･サービス	2,425	17,971.10 43,579,940	18,980.24 46,027,104	1.12
27	DANAHER CORP	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,220	34,179.92 41,699,504	37,148.18 45,320,780	1.10
28	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	131	321,174.98 42,073,923	331,140.09 43,379,353	1.05
29	NISOURCE INC	アメリカ	株式	公益事業	14,760	2,841.74 41,944,522	2,872.69 42,400,941	1.03
30	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	アメリカ	株式	素材	1,272	32,762.34 41,673,705	33,146.88 42,162,843	1.02

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	77.86%
ハイブリッド優先証券	16.43%
投資証券	0.58%
合計	94.87%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.06%
素材	3.56%
資本財・サービス	8.40%
一般消費財・サービス	7.09%
生活必需品	4.57%
ヘルスケア	9.33%
金融	8.34%
情報技術	23.45%
コミュニケーション・サービス	7.10%
公益事業	2.95%
合計	77.86%

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,351,156,687	97.11
	内 スウェーデン	6,345,169	0.46
	内 イギリス	273,008,008	19.62
	内 オランダ	138,721,387	9.97
	内 フランス	282,790,934	20.33
	内 ドイツ	262,922,018	18.90
	内 スイス	276,043,033	19.84
	内 スペイン	22,076,941	1.59
	内 イタリア	89,249,197	6.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		40,147,623	2.89
純資産総額		1,391,304,310	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	5,578	14,102.26 78,662,434	14,802.32 82,567,369	5.93

2	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	44,018.73 57,796,602	44,061.87 57,853,242	4.16
3	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,895	18,511.58 53,591,040	19,420.72 56,223,009	4.04
4	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	95	520,977.75 49,492,886	557,583.00 52,970,385	3.81
5	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	2,117	23,274.31 49,271,720	24,629.03 52,139,673	3.75
6	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	18,113.51 50,717,841	18,562.94 51,976,259	3.74
7	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,883	24,025.51 45,240,037	25,925.97 48,818,618	3.51
8	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,823	6,777.47 46,242,745	6,880.20 46,943,658	3.37
9	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	21,145	2,122.61 44,882,743	2,059.69 43,552,280	3.13
10	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,893	10,803.13 42,056,598	10,993.18 42,796,450	3.08
11	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	903	48,116.80 43,449,470	47,056.85 42,492,336	3.05
12	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	891.16 42,912,288	871.77 41,978,604	3.02
13	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	9,423.69 41,360,597	9,150.08 40,159,701	2.89
14	AXA SA	フランス	株式	金融	12,126	3,043.31 36,903,262	3,112.01 37,736,310	2.71
15	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	88,445	403.14 35,656,566	422.85 37,399,181	2.69
16	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,124.56 33,780,632	2,311.29 36,749,511	2.64
17	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財・サービス	2,155	16,937.27 36,499,836	16,481.42 35,517,468	2.55

18	TOTALENERGIES SE	フランス	株式	エネルギー	6,299	5,624.35 35,427,831	5,290.49 33,324,809	2.40
19	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	11,089.48 33,224,105	11,015.00 33,000,969	2.37
20	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,037	31,049.53 32,198,371	30,702.83 31,838,836	2.29
21	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	7,785	4,866.73 37,887,563	4,076.37 31,734,582	2.28
22	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	87,929	350.81 30,846,910	336.30 29,571,032	2.13
23	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,199.89 32,655,218	1,961.94 29,123,100	2.09
24	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	2,644.41 31,101,009	2,417.07 28,427,263	2.04
25	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	7,271.85 29,014,715	7,111.34 28,374,270	2.04
26	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	25,219.72 28,876,584	24,664.99 28,241,417	2.03
27	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	100,555	323.97 32,584,107	275.18 27,670,989	1.99
28	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	645.64 28,023,602	631.17 27,395,372	1.97
29	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	8,358.20 30,724,769	7,445.21 27,368,599	1.97
30	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	17,873	1,366.16 24,417,410	1,517.41 27,120,824	1.95

(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	97.11%
合計	97.11%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率

エネルギー	5.85%
素材	9.52%
資本財・サービス	11.15%
一般消費財・サービス	5.38%
生活必需品	12.36%
ヘルスケア	15.04%
金融	21.28%
情報技術	3.51%
コミュニケーション・サービス	6.48%
公益事業	6.55%
合計	97.11%

(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。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		653,796,462	97.03
	内　韓国	162,656,646	24.14
	内　中国	35,102,622	5.21
	内　台湾	189,072,659	28.06
	内　香港	70,516,301	10.47
	内　シンガポール	27,488,839	4.08
	内　オーストラリア	168,959,395	25.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,007,221	2.97
純資産総額		673,803,683	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	26,000	2,346.20 61,001,351	2,428.09 63,130,543	9.37
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	6,900	6,648.52 45,874,788	6,926.34 47,791,746	7.09
3	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	4,350	8,292.88 36,074,241	7,623.37 33,161,686	4.92
4	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	13,900	2,326.51 32,338,780	2,211.08 30,734,123	4.56
5	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	22,000	1,280.15 28,163,628	1,224.10 26,930,222	4.00
6	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	6,000	3,439.46 20,636,784	4,217.43 25,304,628	3.76
7	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,700	4,255.53 20,000,998	4,731.89 22,239,887	3.30
8	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	87,000	232.16 20,198,252	255.50 22,228,764	3.30
9	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	2,000	8,986.04 17,972,080	11,112.80 22,225,600	3.30
10	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	6,700	3,076.66 20,614,139	3,135.35 21,006,881	3.12
11	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	3,500	5,230.68 18,307,380	5,297.74 18,542,090	2.75
12	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	9,600	2,054.19 19,720,304	1,700.58 16,325,633	2.42
13	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	2,500	6,768.63 16,921,603	6,492.55 16,231,375	2.41
14	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,000	14,865.50 14,865,502	15,771.07 15,771,073	2.34
15	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,800	2,531.24 14,681,240	2,562.03 14,859,808	2.21

16	NAVER CORP	韓国	株式	コミュニケーション･サービス	390	37,841.00 14,757,990	37,026.70 14,440,413	2.14
17	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	141,000	93.97 13,249,921	99.49 14,029,328	2.08
18	MERIDA INDUSTRY CO LTD	台湾	株式	一般消費財･サービス	11,000	1,105.54 12,160,962	1,220.19 13,422,099	1.99
19	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	3,400	4,205.62 14,299,108	3,908.64 13,289,376	1.97
20	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	香港	株式	資本財･サービス	5,500	2,168.07 11,924,407	2,402.97 13,216,352	1.96
21	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	500	24,135.00 12,067,501	24,956.03 12,478,015	1.85
22	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	13,500	922.08 12,448,188	889.26 12,005,017	1.78
23	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	85,000	132.25 11,241,724	138.80 11,798,590	1.75
24	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	143,000	80.09 11,454,171	73.97 10,577,896	1.57
25	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	23,000	436.07 10,029,723	423.79 9,747,195	1.45
26	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費財･サービス	500	20,022.20 10,011,100	19,207.90 9,603,950	1.43
27	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	6,000	1,472.13 8,832,786	1,411.58 8,469,495	1.26
28	POSCO	韓国	株式	素材	330	31,374.50 10,353,585	25,339.10 8,361,903	1.24
29	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	台湾	株式	資本財･サービス	2,000	3,504.91 7,009,836	3,365.76 6,731,522	1.00
30	CAPITALAND INVESTMENT LTD	シンガポール	株式	不動産	23,900	287.15 6,863,910	280.41 6,701,983	0.99

（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	97.03%
合計	97.03%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.75%
素材	6.47%
資本財・サービス	4.42%
一般消費財・サービス	9.81%
生活必需品	1.73%
ヘルスケア	1.85%
金融	34.77%
情報技術	31.34%
コミュニケーション・サービス	2.64%
不動産	2.25%
合計	97.03%

(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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資状況（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		14,408,122,530	95.01
	内　日本	14,408,122,530	95.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		756,302,943	4.99
純資産総額		15,164,425,473	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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日 立	日本	株式	電気機器	88,500	6,683.00 591,445,500	6,688.00 591,888,000	3.90
2	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	243,500	1,993.50 485,417,250	2,001.00 487,243,500	3.21
3	ＡＧＣ	日本	株式	ｶﾞﾗｽ･土石製品	77,200	5,781.53 446,334,153	5,550.00 428,460,000	2.83
4	ｵﾘｯｸｽ	日本	株式	その他金融業	181,800	2,198.50 399,687,300	2,245.00 408,141,000	2.69
5	東京ｴﾚｸﾄﾛﾝ	日本	株式	電気機器	6,600	49,550.00 327,030,000	59,840.00 394,944,000	2.60
6	富士ﾌｲﾙﾑHLDGS	日本	株式	化学	43,200	9,229.00 398,692,800	8,931.00 385,819,200	2.54
7	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	67,300	6,153.00 414,096,900	5,708.00 384,148,400	2.53
8	ﾃﾞｸｾﾘｱﾙｽﾞ	日本	株式	化学	113,600	2,136.00 242,649,600	3,345.00 379,992,000	2.51
9	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	609,200	657.10 400,305,320	601.40 366,372,880	2.42
10	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報･通信業	108,600	3,733.00 405,403,800	3,300.00 358,380,000	2.36
11	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	95,400	3,867.00 368,911,800	3,703.00 353,266,200	2.33
12	富士電機	日本	株式	電気機器	57,100	5,020.00 286,642,000	5,940.00 339,174,000	2.24
13	大日本印刷	日本	株式	その他製品	119,900	2,826.00 338,837,400	2,663.00 319,293,700	2.11
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	92,700	3,696.00 342,619,200	3,391.00 314,345,700	2.07

15	旭 化 成	日本	株式	化学	260,200	1,220.31 317,525,336	1,071.50 278,804,300	1.84
16	しまむら	日本	株式	小売業	28,500	9,737.57 277,520,854	9,700.00 276,450,000	1.82
17	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用機器	172,700	1,586.00 273,902,200	1,532.00 264,576,400	1.74
18	デンソー	日本	株式	輸送用機器	29,800	7,969.11 237,479,545	8,331.00 248,263,800	1.64
19	プレミアグループ	日本	株式	その他金融業	60,400	3,235.00 195,394,000	3,500.00 211,400,000	1.39
20	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	78,900	2,443.00 192,752,700	2,287.00 180,444,300	1.19
21	ＭＳ＆ＡＤ	日本	株式	保険業	52,200	3,729.00 194,653,800	3,316.00 173,095,200	1.14
22	信越化学	日本	株式	化学	8,800	19,695.00 173,316,000	19,000.00 167,200,000	1.10
23	日本ユニシス	日本	株式	情報･通信業	48,900	3,110.00 152,079,000	3,280.00 160,392,000	1.06
24	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	49,600	3,143.00 155,892,800	3,125.00 155,000,000	1.02
25	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	46,900	3,323.00 155,848,700	3,260.00 152,894,000	1.01
26	豊田自動織機	日本	株式	輸送用機器	16,400	9,740.68 159,747,293	9,320.00 152,848,000	1.01
27	ＴＤＫ	日本	株式	電気機器	33,900	3,775.00 127,972,500	4,500.00 152,550,000	1.01
28	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	184,600	889.00 164,109,400	826.00 152,479,600	1.01
29	武田薬品	日本	株式	医薬品	50,200	3,232.00 162,246,400	3,031.00 152,156,200	1.00
30	村田製作所	日本	株式	電気機器	17,700	8,785.00 155,494,500	8,380.00 148,326,000	0.98

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.01%
合計	95.01%

(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	2.60%
食料品	1.75%
繊維製品	1.89%
化学	14.24%
医薬品	1.00%
ゴム製品	0.41%
ガラス・土石製品	3.68%
鉄鋼	1.00%
非鉄金属	0.72%
金属製品	1.86%
機械	3.49%
電気機器	11.36%
輸送用機器	8.02%
精密機器	0.56%
その他製品	3.15%
陸運業	1.88%
倉庫・運輸関連業	0.82%
情報・通信業	6.10%
卸売業	8.75%
小売業	3.75%
銀行業	4.75%
証券、商品先物取引業	0.69%
保険業	4.86%
その他金融業	4.09%
不動産業	1.13%
サービス業	2.46%
合計	95.01%

(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。

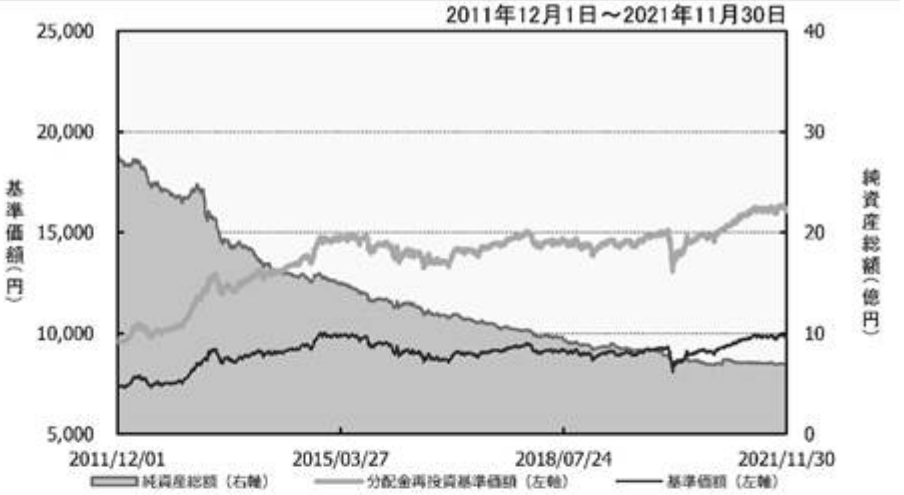
（参考情報）運用実績

●安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2021年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,742円
純資産総額	6.8億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−1.6%
3カ月間	−0.7%
6カ月間	−0.4%
1年間	6.8%
3年間	11.1%
5年間	15.6%
設定来	60.4%

※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：　90円　　設定来分配金合計額：　4,410円

決算期	第85期 20年1月	第86期 20年3月	第87期 20年5月	第88期 20年7月	第89期 20年9月	第90期 20年11月	第91期 21年1月	第92期 21年3月	第93期 21年5月	第94期 21年7月	第95期 21年9月	第96期 21年11月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	34	35.1%
外国債券	34	34.1%
国内株式	109	9.0%
外国株式	156	8.7%
外国リート等	130	5.2%
国内リート・先物	47	4.8%
コール・ローン、その他		3.1%
合計	510	−

通貨別構成	比率
日本円	51.0%
米ドル	14.4%
ユーロ	10.6%
豪ドル	6.1%
英ポンド	5.5%
カナダ・ドル	4.8%
ポーランド・ズロチ	1.9%
デンマーク・クローネ	1.0%
台湾ドル	0.9%
その他	3.8%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.9
最終利回り(%)	0.5
修正デュレーション	7.3
残存年数	8.2

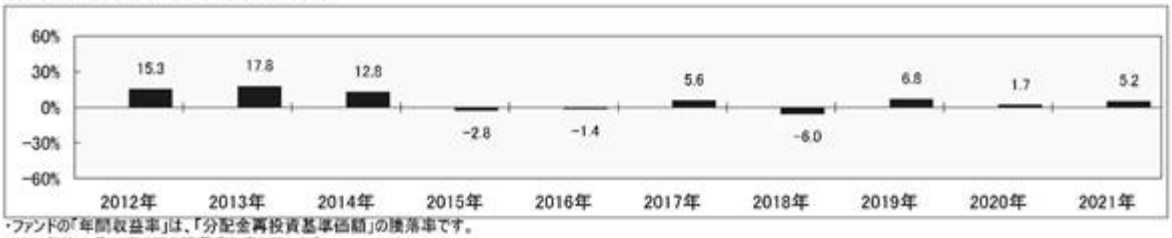
債券格付別構成	比率
AAA	88.7%
AA	8.6%
A	2.7%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

組入上位銘柄		国・地域名	比率
日立	株式	日本	0.4%
トヨタ自動車	株式	日本	0.3%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	台湾	0.3%
AGC	株式	日本	0.3%
オリックス	株式	日本	0.3%
日本ビルファンド	リート	日本	0.4%
GLP投資法人	リート	日本	0.3%
ジャパンリアルエステイト	リート	日本	0.3%
野村不動産マスターF	リート	日本	0.2%
日本都市ファンド投資法人	リート	日本	0.2%
合計			2.9%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2021年は11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】 (2021年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		614,573,971	99.06
	内 日本	614,573,971	99.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,859,957	0.94
純資産総額		620,433,928	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11月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	231,519,658	1.9034 440,684,462	1.8731 433,659,471	69.90
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	18,171,934	3.4479 62,655,011	3.3200 60,330,820	9.72
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,582,433	3.6172 31,044,376	3.6135 31,012,621	5.00
4	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,890,673	3.5244 31,334,700	3.4407 30,590,138	4.93
5	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,572,820	4.3794 20,026,207	4.3821 20,038,554	3.23
6	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,116,298	2.8446 20,243,021	2.7809 19,789,713	3.19
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,425,055	2.1352 20,124,377	2.0321 19,152,654	3.09

(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5月10日)	2,635,394,990	2,655,696,722	0.6491	0.6541
第14特定期間末 (2012年11月12日)	2,219,108,902	2,236,164,141	0.6506	0.6556
第15特定期間末 (2013年5月10日)	2,478,019,937	2,492,374,885	0.8631	0.8681
第16特定期間末 (2013年11月11日)	2,037,542,941	2,050,246,699	0.8019	0.8069
第17特定期間末 (2014年5月12日)	1,862,809,605	1,873,889,871	0.8406	0.8456
第18特定期間末 (2014年11月10日)	1,743,601,679	1,750,248,132	0.9182	0.9217
第19特定期間末 (2015年5月11日)	1,566,235,861	1,572,032,654	0.9457	0.9492
第20特定期間末 (2015年11月10日)	1,377,538,151	1,381,348,553	0.9038	0.9063

第21特定期間末 (2016年5月10日)	1,182,765,323	1,186,295,037	0.8377	0.8402
第22特定期間末 (2016年11月10日)	1,075,473,727	1,078,862,289	0.7935	0.7960
第23特定期間末 (2017年5月10日)	1,046,739,352	1,048,578,766	0.8536	0.8551
第24特定期間末 (2017年11月10日)	944,076,847	945,657,477	0.8959	0.8974
第25特定期間末 (2018年5月10日)	882,622,419	884,155,888	0.8634	0.8649
第26特定期間末 (2018年11月12日)	824,034,111	825,480,307	0.8547	0.8562
第27特定期間末 (2019年5月10日)	766,179,336	767,537,727	0.8461	0.8476
第28特定期間末 (2019年11月11日)	745,325,595	746,608,415	0.8715	0.8730
第29特定期間末 (2020年5月11日)	618,770,175	619,893,950	0.8259	0.8274
第30特定期間末 (2020年11月10日)	643,652,906	644,740,886	0.8874	0.8889
2020年11月末日	641,165,289	－	0.8929	－
12月末日	638,713,451	－	0.9106	－
2021年1月末日	627,327,847	－	0.9159	－
2月末日	618,825,505	－	0.9222	－
3月末日	632,760,563	－	0.9475	－
4月末日	631,928,267	－	0.9560	－
第31特定期間末 (2021年5月10日)	634,877,275	635,866,223	0.9630	0.9645
5月末日	636,477,832	－	0.9693	－
6月末日	632,704,946	－	0.9672	－
7月末日	633,769,770	－	0.9678	－
8月末日	629,085,893	－	0.9670	－
9月末日	619,009,255	－	0.9560	－
10月末日	633,619,726	－	0.9789	－
第32特定期間末 (2021年11月10日)	628,637,499	629,608,621	0.9710	0.9725
11月末日	620,433,928	－	0.9525	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第13特定期間	0.0200
第14特定期間	0.0150
第15特定期間	0.0150
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0135
第19特定期間	0.0105
第20特定期間	0.0095
第21特定期間	0.0075
第22特定期間	0.0075
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045
第28特定期間	0.0045
第29特定期間	0.0045
第30特定期間	0.0045
第31特定期間	0.0045
第32特定期間	0.0045

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第13特定期間	5.5
第14特定期間	2.5
第15特定期間	35.0
第16特定期間	△5.4
第17特定期間	6.7
第18特定期間	10.8
第19特定期間	4.1
第20特定期間	△3.4
第21特定期間	△6.5
第22特定期間	△4.4
第23特定期間	8.1
第24特定期間	5.5
第25特定期間	△3.1
第26特定期間	△0.5

第27特定期間	△0.5
第28特定期間	3.5
第29特定期間	△4.7
第30特定期間	8.0
第31特定期間	9.0
第32特定期間	1.3

(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	25,529,761	670,707,349
第14特定期間	14,620,571	663,919,130
第15特定期間	15,840,309	555,898,540
第16特定期間	15,453,145	345,691,091
第17特定期間	11,255,874	335,954,300
第18特定期間	9,451,531	326,518,165
第19特定期間	29,475,271	272,235,197
第20特定期間	46,300,831	178,366,471
第21特定期間	24,051,624	136,327,052
第22特定期間	10,094,094	66,554,667
第23特定期間	6,086,004	135,234,627
第24特定期間	10,558,332	183,081,271
第25特定期間	12,683,654	44,124,014
第26特定期間	5,144,673	63,327,127
第27特定期間	7,944,020	66,480,539
第28特定期間	4,826,658	55,206,979
第29特定期間	5,358,492	111,388,864
第30特定期間	10,162,525	34,025,491
第31特定期間	5,581,535	71,602,996
第32特定期間	14,180,659	26,064,725

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

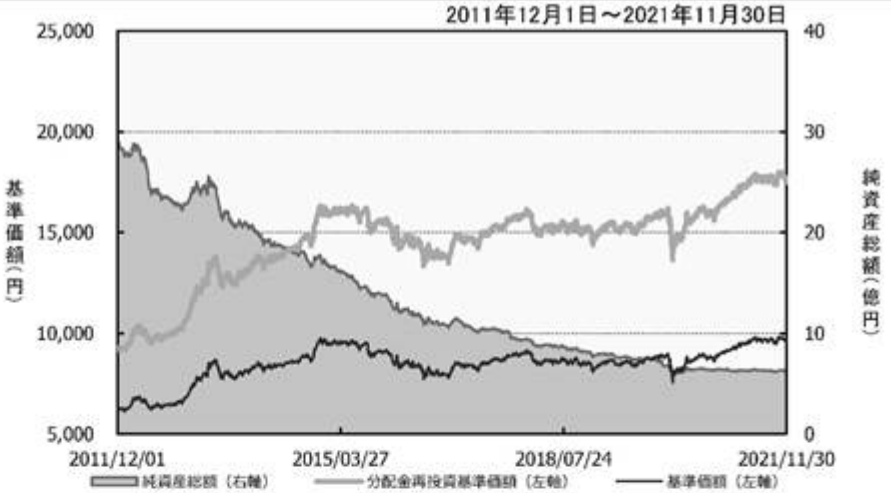
2021年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,525円
純資産総額	6.2億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−2.5%
3カ月間	−1.2%
6カ月間	−1.3%
1年間	7.7%
3年間	14.5%
5年間	21.5%
設定来	74.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　90円　　設定来分配金合計額：　5,040円

決算期	第85期 20年1月	第86期 20年3月	第87期 20年5月	第88期 20年7月	第89期 20年9月	第90期 20年11月	第91期 21年1月	第92期 21年3月	第93期 21年5月	第94期 21年7月	第95期 21年9月	第96期 21年11月
分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円	15円

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

主要な資産の状況

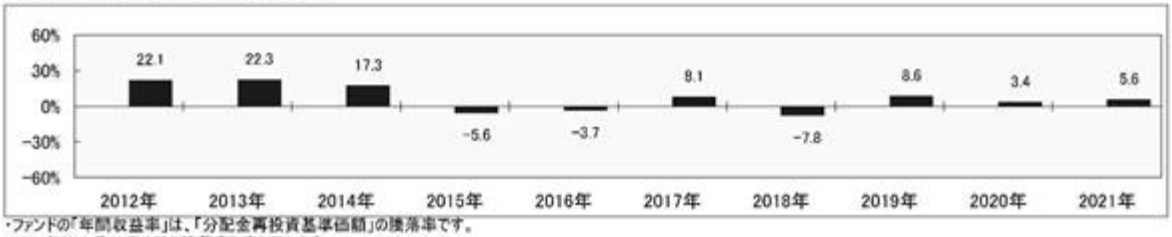
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄		国・地域名	比率
外国債券	34	68.5%	米ドル	23.2%	直接利回り(%)	1.9	株式	日 立	日本	0.4%
国内株式	109	9.2%	ユーロ	18.9%	最終利回り(%)	1.0	株式	トヨタ自動車	日本	0.3%
外国株式	156	8.6%	日本円	15.9%	修正デュレーション	7.7	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.3%
外国リート等	130	5.2%	豪ドル	10.7%	残存年数	8.9	株式	AGC	日本	0.3%
国内リート・先物	47	4.9%	英ポンド	9.9%	債券格付別構成	比率	株式	オリックス	日本	0.3%
			カナダ・ドル	9.6%	AAA	77.0%	リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
			ポーランド・ズロチ	3.9%	AA	17.4%	リート	GLP投資法人	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	2.0%	A	5.6%	リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.3%	BBB	−	リート	野村不動産マスターF	日本	0.3%
コール・ローン、その他		3.6%	その他	4.5%	BB	−	リート	日本都市ファンド投資法人	日本	0.2%
合計	476	−	合計	100.0%	合計	100.0%	合計			3.0%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2021年は11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（2021年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		3,063,964,591	99.15
	内 日本	3,063,964,591	99.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		26,128,870	0.85
純資産総額		3,090,093,461	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11月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	318,144,008	3.4481 1,097,019,002	3.3200 1,056,238,106	34.18
2	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	335,375,079	1.9035 638,399,513	1.8731 628,191,060	20.33
3	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	83,319,748	4.3794 364,890,506	4.3821 365,115,467	11.82
4	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	128,220,628	2.8450 364,797,445	2.7809 356,568,744	11.54
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	171,814,081	2.1352 366,857,428	2.0321 349,143,394	11.30
6	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	43,049,016	3.6172 155,716,904	3.6135 155,557,619	5.03
7	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	44,511,350	3.5243 156,873,262	3.4407 153,150,201	4.96

(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	99.15%
合計	99.15%

(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5月10日)	9,250,480,800	9,313,005,488	0.5918	0.5958
第14特定期間末 (2012年11月12日)	8,222,189,610	8,278,659,413	0.5824	0.5864
第15特定期間末 (2013年5月10日)	10,860,474,430	10,910,648,846	0.8658	0.8698
第16特定期間末 (2013年11月11日)	9,327,922,637	9,372,482,501	0.8373	0.8413
第17特定期間末 (2014年5月12日)	8,513,202,227	8,552,128,762	0.8748	0.8788
第18特定期間末 (2014年11月10日)	8,133,973,146	8,166,656,270	0.9955	0.9995
第19特定期間末 (2015年5月11日)	7,225,488,064	7,395,649,150	1.0191	1.0431
第20特定期間末 (2015年11月10日)	6,532,848,494	6,559,720,979	0.9724	0.9764
第21特定期間末 (2016年5月10日)	5,551,044,127	5,576,599,040	0.8689	0.8729

第22特定期間末 (2016年11月10日)	5,116,194,834	5,140,460,598	0.8434	0.8474
第23特定期間末 (2017年5月10日)	5,287,390,510	5,309,662,342	0.9496	0.9536
第24特定期間末 (2017年11月10日)	5,057,631,350	5,077,504,216	1.0180	1.0220
第25特定期間末 (2018年5月10日)	4,653,393,092	4,672,305,292	0.9842	0.9882
第26特定期間末 (2018年11月12日)	4,168,672,375	4,186,518,075	0.9344	0.9384
第27特定期間末 (2019年5月10日)	3,794,279,955	3,811,358,261	0.8887	0.8927
第28特定期間末 (2019年11月11日)	3,761,340,903	3,777,373,246	0.9384	0.9424
第29特定期間末 (2020年5月11日)	3,058,775,631	3,073,722,465	0.8186	0.8226
第30特定期間末 (2020年11月10日)	3,291,713,061	3,306,146,732	0.9122	0.9162
2020年11月末日	3,293,031,661	－	0.9266	－
12月末日	3,343,622,150	－	0.9573	－
2021年1月末日	3,321,370,426	－	0.9694	－
2月末日	3,376,484,563	－	1.0022	－
3月末日	3,483,931,983	－	1.0535	－
4月末日	3,437,776,396	－	1.0616	－
第31特定期間末 (2021年5月10日)	3,395,326,766	3,475,919,783	1.0532	1.0782
5月末日	3,375,045,265	－	1.0546	－
6月末日	3,368,028,319	－	1.0593	－
7月末日	3,246,433,937	－	1.0297	－
8月末日	3,264,331,988	－	1.0352	－
9月末日	3,225,536,212	－	1.0252	－
10月末日	3,280,667,068	－	1.0478	－
第32特定期間末 (2021年11月10日)	3,185,913,394	3,263,859,118	1.0218	1.0468
11月末日	3,090,093,461	－	0.9951	－

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	0.0620
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0170
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120
第30特定期間	0.0120
第31特定期間	0.0330
第32特定期間	0.0650

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第13特定期間	9.3
第14特定期間	0.4
第15特定期間	50.7
第16特定期間	△1.9
第17特定期間	5.9
第18特定期間	15.2
第19特定期間	8.6
第20特定期間	△3.4
第21特定期間	△9.4
第22特定期間	△1.6
第23特定期間	14.0
第24特定期間	8.5
第25特定期間	△1.7
第26特定期間	△3.8
第27特定期間	△3.6
第28特定期間	6.9

第29特定期間	△11.5
第30特定期間	12.9
第31特定期間	19.1
第32特定期間	3.2

(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	55,178,530	2,078,826,213
第14特定期間	53,311,081	1,567,032,356
第15特定期間	68,212,204	1,642,058,854
第16特定期間	42,879,794	1,446,517,832
第17特定期間	54,417,883	1,462,750,164
第18特定期間	33,525,544	1,594,378,200
第19特定期間	75,174,262	1,155,910,225
第20特定期間	80,486,286	452,410,273
第21特定期間	25,129,059	354,521,879
第22特定期間	35,863,134	358,150,519
第23特定期間	29,786,290	528,269,188
第24特定期間	54,376,920	654,118,402
第25特定期間	42,388,187	282,554,834
第26特定期間	24,330,190	290,955,202
第27特定期間	29,326,275	221,174,687
第28特定期間	27,601,125	289,091,902
第29特定期間	27,702,752	299,080,075
第30特定期間	31,943,313	160,233,931
第31特定期間	24,319,139	409,016,346
第32特定期間	53,510,881	159,402,589

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

―

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2021年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,951円
純資産総額	30億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−2.7%
3カ月間	−0.1%
6カ月間	0.4%
1年間	18.0%
3年間	24.5%
5年間	36.7%
設定来	117.5%

※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：　980円　　設定来分配金合計額：　7,180円

決算期	第85期 20年1月	第86期 20年3月	第87期 20年5月	第88期 20年7月	第89期 20年9月	第90期 20年11月	第91期 21年1月	第92期 21年3月	第93期 21年5月	第94期 21年7月	第95期 21年9月	第96期 21年11月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	250円	250円	150円	250円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	109	32.5%
外国株式	156	31.4%
外国債券	34	19.9%
外国リート等	130	6.7%
国内リート・先物	47	4.9%
コール・ローン、その他		4.7%
合計	476	−

通貨別構成	比率
日本円	40.6%
米ドル	18.9%
ユーロ	12.0%
豪ドル	6.3%
英ポンド	5.3%
台湾ドル	3.3%
カナダ・ドル	3.1%
韓国ウォン	2.8%
スイス・フラン	2.2%
その他	5.4%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.9
最終利回り(%)	1.0
修正デュレーション	7.7
残存年数	8.9

債券格付別構成	比率
AAA	77.0%
AA	17.4%
A	5.6%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

	組入上位銘柄	国・地域名	比率
株式	日 立	日本	1.3%
株式	トヨタ自動車	日本	1.1%
株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	1.1%
株式	AGC	日本	1.0%
株式	オリックス	日本	0.9%
リート	日本ビルファンド	日本	0.4%
リート	GLP投資法人	日本	0.3%
リート	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
リート	野村不動産マスターF	日本	0.3%
リート	日本都市ファンド投資法人	日本	0.2%
合計			6.9%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2021年は11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、委託会社および販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパ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またはＩＣＥフューチャーズ・ヨーロッパ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
・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
・海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)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1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、および11月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2005年11月14日から2006年1月10日までとします。

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

(5)【その他】

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5月および11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】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2021年5月11日から2021年11月10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】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,187,073	8,980,883
親投資信託受益証券	707,992,664	687,497,356
未収入金	―	4,000,000
流動資産合計	718,179,737	700,478,239
資産合計	718,179,737	700,478,239
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,094,758	1,056,728
未払解約金	630,802	2,292,052
未払受託者報酬	65,208	64,107
未払委託者報酬	1,500,171	1,474,713
その他未払費用	29,160	29,141
流動負債合計	3,320,099	4,916,741
負債合計	3,320,099	4,916,741
純資産の部		
元本等		
元本	※1 729,839,118	※1 704,485,598
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 14,979,480	※2 △ 8,924,100
（分配準備積立金）	23,838,144	27,453,044
元本等合計	714,859,638	695,561,498
純資産合計	714,859,638	695,561,498
負債純資産合計	718,179,737	700,478,239

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10日
営業収益		
受取利息	1	―
有価証券売買等損益	55,945,771	13,504,692
営業収益合計	55,945,772	13,504,692
営業費用		
支払利息	796	1,225
受託者報酬	194,974	194,840
委託者報酬	※1 4,485,648	※1 4,482,379
その他費用	29,160	29,141
営業費用合計	4,710,578	4,707,585
営業利益	51,235,194	8,797,107
経常利益	51,235,194	8,797,107
当期純利益	51,235,194	8,797,107
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	742,540	△ 27,370
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 64,113,059	△ 14,979,480
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,125,453	914,815
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,125,453	914,815
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,092,835	479,995
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,092,835	479,995
分配金	※2 3,391,693	※2 3,203,917
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 14,979,480	△ 8,924,100

(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5月11日 至　2021年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
1.　※1　期首元本額	762,437,992円	729,839,118円
期中追加設定元本額	61,263,599円	30,258,792円
期中一部解約元本額	93,862,473円	55,612,312円
2.　特定期間末日における受益権の総数	729,839,118口	704,485,598口
3.　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は14,979,480円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,924,100円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10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	204,551円	202,350円

2．※2 分配金の計算過程	（自2020年11月11日　至2021年1月12日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,186,198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（3,343,301円）及び分配準備積立金（16,646,447円）より分配対象額は22,175,946円（1万口当たり281.42円）であり、うち1,182,003円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2021年1月13日　至2021年3月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,099,809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（3,192,575円）及び分配準備積立金（16,611,161円）より分配対象額は21,903,545円（1万口当たり294.68円）であり、うち1,114,932円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年7月12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（1,834,148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（3,232,915円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,365,868円）及び分配準備積立金（23,135,473円）より分配対象額は31,568,404円（1万口当たり441.66円）であり、うち1,072,150円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2021年7月13日　至2021年9月10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（1,397,394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（901,798円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,945,171円）及び分配準備積立金（26,645,819円）より分配対象額は32,890,182円（1万口当たり458.92円）であり、うち1,075,039円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	

	（自2021年3月11日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,818,321円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（4,915,025円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,215,422円）及び分配準備積立金（17,199,556円）より分配対象額は28,148,324円（1万口当たり385.68円）であり、うち1,094,758円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2021年9月11日　至2021年11月10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（1,264,659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（193,563円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,232,201円）及び分配準備積立金（27,051,550円）より分配対象額は32,741,973円（1万口当たり464.76円）であり、うち1,056,728円（1万口当たり15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5月11日 至　2021年11月10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11月10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	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
	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	20,743,933	2,764,395
合計	20,743,933	2,764,395

（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5月10日現在	当　期 2021年11月10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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9795円 (9,795円)	0.9873円 (9,873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	126,783,193	241,344,486	
	ダイワ日本国債マザーファンド	192,275,051	242,862,616	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	9,420,536	34,075,962	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	19,842,510	68,414,990	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	5,037,046	22,059,239	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	10,479,745	22,376,351	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	7,882,565	22,422,744	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	9,630,556	33,940,968	
親投資信託受益証券　合計			687,497,356	
合計			687,497,356	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、当ファンドの特定期間末日（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5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	113,063,265	144,124,254
コール・ローン	12,841,887	26,386,432
国債証券	19,689,262,627	18,687,056,235
特殊債券	1,009,968,505	997,032,538
派生商品評価勘定	4,658,461	2,520,000
未収入金	30,263,128	―
未収利息	100,483,090	118,796,716
前払費用	8,261,393	2,005,750
差入委託証拠金	130,218,097	131,475,285
流動資産合計	21,099,020,453	20,109,397,210
資産合計	21,099,020,453	20,109,397,210
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,152,200	4,576,629
未払解約金	30,889,380	52,537,410
その他未払費用	19	―
流動負債合計	36,041,599	57,114,039
負債合計	36,041,599	57,114,039
純資産の部		
元本等		
元本　※1	11,121,188,653	10,533,894,864
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,941,790,201	9,518,388,307
元本等合計	21,062,978,854	20,052,283,171
純資産合計	21,062,978,854	20,052,283,171
負債純資産合計	21,099,020,453	20,109,397,210

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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1.　※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	11,842,151,061円	11,121,188,653円
期中追加設定元本額	119,048,933円	91,696,162円
期中一部解約元本額	840,011,341円	678,989,951円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,331,766,095円	1,282,746,832円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	685,361,584円	642,475,429円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	39,541,599円	40,798,790円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	131,001,808円	126,783,193円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	233,080,931円	228,873,956円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	352,142,056円	333,789,213円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	172,613,676円	170,813,045円
６資産バランスファンド（分配型）	814,575,398円	805,660,071円
６資産バランスファンド（成長型）	100,645,804円	105,919,997円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	4,660,059,511円	4,330,539,878円

世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	51,359,652円	46,119,653円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	181,795,213円	174,587,926円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	706,422,169円	715,899,237円
『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	12,545,025円	－円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	180,277,386円	165,503,250円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	755,860,633円	706,910,370円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	20,212,976円	17,371,134円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年1回決算型）	536,365,891円	504,562,532円
四国アライアンス　地域創生ファンド（年2回決算型）	155,561,246円	134,540,358円
計	11,121,188,653円	10,533,894,864円
2.　期末日における受益権の総数	11,121,188,653口	10,533,894,864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5月11日 至　2021年11月10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11月10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5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△13,590,850	82,882,264
特殊債券	2,540,494	△9,616,631
合計	△11,050,356	73,265,633

（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（2021年4月13日から2021年5月10日まで、及び2021年10月12日から2021年11月10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

	2021年5月10日 現在	2021年11月10日 現在

種　類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	423,512,717	－	428,555,210	△5,042,493	318,873,000	－	316,389,650	2,483,350
アメリカ・ドル	31,652,717	－	31,543,010	109,707	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	41,568,000	－	41,604,650	△36,650
ユーロ	391,860,000	－	397,012,200	△5,152,200	277,305,000	－	274,785,000	2,520,000
買　建	391,860,000	－	396,408,754	4,548,754	277,305,000	－	272,765,021	△4,539,979
アメリカ・ドル	261,240,000	－	263,525,254	2,285,254	132,050,000	－	131,031,162	△1,018,838
オーストラリア・ドル	130,620,000	－	132,883,500	2,263,500	145,255,000	－	141,733,859	△3,521,141
合計	815,372,717	－	824,963,964	△493,739	596,178,000	－	589,154,671	△2,056,629

（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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8940円 (18,940円)	1.9036円 (19,036円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	アメリカ・ドル 13,998,800.000	アメリカ・ドル 14,835,368.280	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,300,000.000	1,151,358.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	27,183,400.000	25,996,029.080	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 41,982,755.360 (4,738,173,771)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	イギリス・ポンド 4,320,000.000	イギリス・ポンド 4,519,670.400	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	3,419,168.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,928,686.980	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	3,315,900.000	3,812,024.950	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,724,390.000	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 16,403,940.330 (2,509,310,752)	
	オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	オーストラリア・ドル 1,957,000.000	オーストラリア・ドル 2,305,698.260	

	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	3,240,431.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	24,232,030.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 29,778,159.260 (2,477,840,632)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,957,455.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,700,000.000	1,994,457.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	4,743,000.000	4,783,884.660	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	11,046,000.000	10,072,295.100	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 18,808,091.760 (1,705,893,922)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	13,630,000.000	14,098,872.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	14,941,926.900	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 29,040,798.900 (382,176,914)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,930,745.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	20,200,000.000	22,041,836.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 31,972,581.000 (562,397,700)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	20,778,400.000	

	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 20,778,400.000 (275,729,368)	
	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 5,597,700.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	8,000,000.000	7,016,880.000	
		4% Poland Government Bond 20231025	2,100,000.000	2,149,560.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	24,912,500.000	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 39,676,640.000 (1,130,014,514)	
	ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	ユーロ 695,000.000	ユーロ 1,148,390.200	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	4,750,400.000	7,623,584.430	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,560,530.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	2,872,000.000	3,067,870.400	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,609,742.300	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	8,660,000.000	9,533,534.200	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	9,979,435.520	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	960,000.000	972,278.400	
	ユーロ　小計			ユーロ 37,495,365.450 (4,905,518,662)	
国債証券　合計				18,687,056,235 [18,687,056,235]	
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 2,925,235.400	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,830,000.000	8,067,405.600	

	カナダ・ドル　小計		カナダ・ドル 10,992,641.000 (997,032,538)	
特殊債券　合計			997,032,538 [997,032,538]	
合計			19,684,088,773 [19,684,088,773]	

（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%	12.7%
オーストラリア・ドル	国債証券　3銘柄	100%	12.6%
カナダ・ドル	国債証券　4銘柄 特殊債券　2銘柄	100%	13.7%
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%	2.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券　1銘柄	100%	1.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券　4銘柄	100%	5.7%
ユーロ	国債証券　8銘柄	100%	25.0%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン	477,320,319	310,537,326
国債証券	169,704,234,500	149,054,496,840
未収入金	―	246,512,000
未収利息	870,667,128	760,997,312
前払費用	7,793,142	8,177,526
流動資産合計	171,060,015,089	150,380,721,004
資産合計	171,060,015,089	150,380,721,004
負債の部		
流動負債		
未払解約金	128,924,197	170,882,469
その他未払費用	276	―
流動負債合計	128,924,473	170,882,469
負債合計	128,924,473	170,882,469
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	135,624,650,616	118,922,870,269
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,306,440,000	31,286,968,266
元本等合計	170,931,090,616	150,209,838,535
純資産合計	170,931,090,616	150,209,838,535
負債純資産合計	171,060,015,089	150,380,721,004

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5月11日 至　2021年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1.　※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	148,784,226,234円	135,624,650,616円
期中追加設定元本額	784,109,378円	440,530,894円
期中一部解約元本額	13,943,684,996円	17,142,311,241円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	40,727円	1,371,021円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	194,644,209円	192,275,051円
６資産バランスファンド（分配型）	239,983,081円	239,983,584円
６資産バランスファンド（成長型）	148,862,762円	159,144,494円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	124,518,950,971円	109,299,894,465円
世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	75,465,017円	69,118,329円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	35,832,457円	34,249,988円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	10,249,652,263円	8,858,283,075円
ダイワ・ニッポン応援ファンドVol.4 －日本の真価－（国債コース）	161,219,129円	68,550,262円
計	135,624,650,616円	118,922,870,269円
2.　期末日における受益権の総数	135,624,650,616口	118,922,870,269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5月11日 至　2021年11月10日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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11月10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5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	79,339,410	△990,777,310
合計	79,339,410	△990,777,310

（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（2021年3月11日から2021年5月10日まで、及び2021年3月11日から2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2603円 (12,603円)	1.2631円 (12,631円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	１　３０年国債	4,150,000,000	5,081,011,000	
	４　３０年国債	1,600,000,000	2,018,736,000	
	６　３０年国債	3,550,000,000	4,377,753,500	
	８　３０年国債	200,000,000	237,092,000	
	１２　３０年国債	4,500,000,000	5,535,180,000	
	１５　３０年国債	3,400,000,000	4,383,042,000	
	１６　３０年国債	4,400,000,000	5,693,512,000	
	１９　３０年国債	3,500,000,000	4,479,440,000	
	２０　３０年国債	4,200,000,000	5,506,242,000	
	２３　３０年国債	3,300,000,000	4,361,610,000	
	２４　３０年国債	4,200,000,000	5,565,672,000	
	５４　２０年国債	5,987,000,000	6,001,728,020	
	５６　２０年国債	3,700,000,000	3,747,397,000	
	５９　２０年国債	5,695,000,000	5,809,184,750	
	６３　２０年国債	4,200,000,000	4,328,982,000	
	６８　２０年国債	4,325,000,000	4,560,712,500	

	７０　２０年国債	5,038,000,000	5,369,097,360	
	７５　２０年国債	4,274,000,000	4,592,669,440	
	８０　２０年国債	4,973,000,000	5,370,790,270	
	８６　２０年国債	4,000,000,000	4,420,720,000	
	８８　２０年国債	4,860,000,000	5,400,918,000	
	９４　２０年国債	4,300,000,000	4,809,120,000	
	９５　２０年国債	4,605,000,000	5,227,964,400	
	１０１　２０年国債	4,560,000,000	5,285,541,600	
	１０２　２０年国債	4,200,000,000	4,893,294,000	
	１１０　２０年国債	1,700,000,000	1,972,663,000	
	１１１　２０年国債	2,500,000,000	2,931,675,000	
	１１６　２０年国債	3,700,000,000	4,392,788,000	
	１２１　２０年国債	4,500,000,000	5,259,645,000	
	１２５　２０年国債	2,000,000,000	2,407,040,000	
	１３０　２０年国債	4,500,000,000	5,272,470,000	
	１４０　２０年国債	4,500,000,000	5,276,160,000	
	１４５　２０年国債	3,800,000,000	4,484,646,000	
国債証券　合計			149,054,496,840	
合計			149,054,496,840	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,130,728,330	3,015,052,866
コール・ローン	768,896,764	624,835,723
投資証券	80,423,417,677	94,727,773,260
派生商品評価勘定	340	―

未収入金	183,947,147	162,042,094
未収配当金	91,325,475	56,953,291
流動資産合計	84,598,315,733	98,586,657,234
資産合計	84,598,315,733	98,586,657,234
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,473	―
未払金	168,986,683	498,667,665
未払解約金	67,531,000	22,508,000
その他未払費用	116	―
流動負債合計	236,536,272	521,175,665
負債合計	236,536,272	521,175,665
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	26,639,729,475	27,111,171,767
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	57,722,049,986	70,954,309,802
元本等合計	84,361,779,461	98,065,481,569
純資産合計	84,361,779,461	98,065,481,569
負債純資産合計	84,598,315,733	98,586,657,234

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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1．※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	29,135,373,353円	26,639,729,475円
期中追加設定元本額	46,342,326円	1,942,575,398円
期中一部解約元本額	2,541,986,204円	1,471,133,106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）	23,207,364,697円	23,042,953,152円

	ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	26,480,492円	24,077,142円
	安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,516,206円	9,420,536円
	インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	9,750,008円	8,582,433円
	成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	52,947,867円	43,868,174円
	６資産バランスファンド（分配型）	98,526,965円	86,147,757円
	６資産バランスファンド（成長型）	259,564,523円	232,803,656円
	りそな ワールド・リート・ファンド	1,183,606,533円	1,070,378,748円
	世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	31,563,635円	25,203,857円
	『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	1,872,015円	－円
	常陽３分法ファンド	140,845,475円	110,475,898円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	32,615,720円	26,438,511円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	321,080,548円	308,609,194円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	395,787,304円	391,190,575円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	543,889,123円	563,929,473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）	276,242,338円	244,220,270円
	ダイワ外国３資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）	21,072,072円	18,501,359円
	ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	25,003,954円	22,431,304円
計		26,639,729,475円	27,111,171,767円

2.　期末日における受益権の総数	26,639,729,475口	27,111,171,767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5月11日 至　2021年11月10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11月10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

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在

種　類	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	5,874,620,458	3,380,096,679
合計	5,874,620,458	3,380,096,679

（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（2021年3月16日から2021年5月10日まで、及び2021年9月16日から2021年11月10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5月10日 現在				2021年11月10日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	21,461,573	－	21,461,233	340	－	－	－	－
シンガポール・ドル	21,461,573	－	21,461,233	340	－	－	－	－
買　建	21,461,573	－	21,443,100	△18,473	－	－	－	－
アメリカ・ドル	21,461,573	－	21,443,100	△18,473	－	－	－	－
合計	42,923,146	－	42,904,333	△18,133	－	－	－	－

（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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1668円 (31,668円)	3.6172円 (36,172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	31,810	7,638,535.300	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	193,376	32,388,546.240	
		EQUINIX INC	23,191	18,501,547.890	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	895,143	16,407,971.190	
		CYRUSONE INC	198,334	16,140,420.920	
		KIMCO REALTY CORP	490,972	11,415,099.000	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	225,433	7,576,803.130	
		INVITATION HOMES INC	357,788	14,501,147.640	
		AMERICOLD REALTY TRUST	292,556	8,560,188.560	
		VICI PROPERTIES INC	557,328	16,296,270.720	
		APARTMENT INCOME REIT CO	184,174	9,823,841.160	
		VENTAS INC	200,463	10,588,455.660	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	131,771	6,427,789.380	
		SUN COMMUNITIES INC	42,654	8,264,212.500	
		PROLOGIS INC	135,689	20,143,032.050	
		COUSINS PROPERTIES INC	159,414	6,354,242.040	
		SITE CENTERS CORP	137,129	2,299,653.330	
		DUKE REALTY CORP	496,016	28,099,306.400	

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	50,517	17,208,110.880	
	WELLTOWER INC	317,001	27,068,715.390	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	559,380	19,007,732.400	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,293	2,493,579.470	
	REALTY INCOME CORP	322,186	22,862,318.560	
	PUBLIC STORAGE	92,735	30,138,875.000	
	REGENCY CENTERS CORP	92,402	6,810,027.400	
	UDR INC	377,663	20,854,550.860	
	AGREE REALTY CORP	55,255	3,855,141.350	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	88,899	13,970,477.850	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	63,980	12,649,485.800	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 418,346,078.070 (47,214,538,371)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD	1,547,368	2,936,130.780	
	ASSURA PLC	7,565,664	5,526,717.550	
	SEGRO PLC	1,091,812	14,461,049.940	
	BRITISH LAND CO PLC	1,345,662	6,809,049.720	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	315,933	2,369,497.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	361,727	2,971,587.300	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	653,508	8,064,288.720	
	BIG YELLOW GROUP PLC	245,719	3,698,070.950	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,764,387	4,756,787.350	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,348,035	12,172,127.660	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 63,765,307.470 (9,754,179,083)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	2,180,303	24,462,999.660	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	3,369,909	7,144,207.080	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED	416,486	158,931.050	
	NATIONAL STORAGE REIT	5,303,947	12,782,512.270	
	MIRVAC GROUP	7,031,208	20,109,254.880	
	GOODMAN GROUP	2,126,245	50,073,069.750	
	CHARTER HALL GROUP	2,183,872	41,799,310.080	

	INGENIA COMMUNITIES GROUP	1,765,901	11,284,107.390	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 167,814,392.160 (13,963,835,572)	
カナダ・ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	845,748	カナダ・ドル 19,350,714.240	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 19,350,714.240 (1,755,109,781)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	1,275,541	シンガポール・ドル 2,997,521.350	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	10,908,100	16,471,231.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	11,041,332	23,738,863.800	
	KEPPEL REIT	13,856,500	15,934,975.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,991,877	24,210,603.450	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 83,353,194.600 (6,984,164,176)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,272,952	ニュージーランド・ドル 10,255,084.800	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 10,255,084.800 (824,713,920)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	348,205	ユーロ 7,244,405.020	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	255,349	4,971,645.030	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	55,903	3,864,574.390	
	NSI NV	54,911	1,952,086.050	
	ICADE	98,537	6,759,638.200	
	ARGAN	54,690	6,169,032.000	
	GECINA SA	11,832	1,450,603.200	
	KLEPIERRE	704,489	15,618,521.130	
	AEDIFICA	75,820	8,764,792.000	
	COFINIMMO	51,664	7,315,622.400	
	BEFIMMO	99,277	3,529,297.350	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	282,418	11,353,203.600	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	40,794	2,100,891.000	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	680,301	6,568,986.450	

	ユーロ　小計			ユーロ 87,663,297.820 (11,468,989,254)	
	香港・ドル	LINK REIT	2,742,892	香港・ドル 190,630,994.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 190,630,994.000 (2,762,243,103)	
投資証券　合計				94,727,773,260 [94,727,773,260]	
合計				94,727,773,260 [94,727,773,260]	

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　29銘柄	100%	49.8%
イギリス・ポンド	投資証券　10銘柄	100%	10.3%
オーストラリア・ドル	投資証券　8銘柄	100%	14.7%
カナダ・ドル	投資証券　1銘柄	100%	1.9%
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%	12.1%
香港・ドル	投資証券　1銘柄	100%	2.9%

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
該当事項はありません。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,876,520,969	3,044,577,729
投資証券　※2	111,373,849,950	123,560,248,200
派生商品評価勘定	181,972,490	―
未収入金	478,211,970	661,791,677
未収配当金	850,977,937	1,170,393,593
前払金	―	100,320,000
流動資産合計	115,761,533,316	128,537,331,199
資産合計	115,761,533,316	128,537,331,199
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	120,130	111,852,000
前受金	182,405,000	―
未払金	394,448,740	569,544,744
未払解約金	15,572,000	44,410,000
その他未払費用	1,386	―
流動負債合計	592,547,256	725,806,744
負債合計	592,547,256	725,806,744
純資産の部		
元本等		
元本　※1	33,552,990,780	36,265,606,080
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	81,615,995,280	91,545,918,375
元本等合計	115,168,986,060	127,811,524,455
純資産合計	115,168,986,060	127,811,524,455
負債純資産合計	115,761,533,316	128,537,331,199

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5月11日 至　2021年11月10日

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1．※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	31,367,619,624円	33,552,990,780円
期中追加設定元本額	3,805,637,625円	3,058,220,855円
期中一部解約元本額	1,620,266,469円	345,605,555円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	30,843,180,147円	33,509,665,629円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,179,969円	9,630,556円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	8,875,118円	8,607,298円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	48,070,130円	44,228,410円
６資産バランスファンド（分配型）	88,456,510円	84,568,014円

	６資産バランスファンド（成長型）	234,873,769円	224,395,505円
	世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）	28,515,570円	24,265,422円
	『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	855,105円	－円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	29,253,531円	26,757,433円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	288,467,556円	302,386,189円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	353,962,639円	382,318,755円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	487,789,845円	560,082,597円
	ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	331,957,138円	307,184,059円
	ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	72,482,840円	64,045,729円
	ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	22,402,775円	19,549,156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）	106,152,216円	98,365,944円
	ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年4回決算型）	597,515,922円	599,555,384円
計		33,552,990,780円	36,265,606,080円
2.	期末日における受益権の総数	33,552,990,780口	36,265,606,080口
3. ※2	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,169,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　1,179,400,000円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2021年5月11日 至　2021年11月10日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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11月10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5月10日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2021年11月10日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	15,430,819,286	△1,260,299,797
合計	15,430,819,286	△1,260,299,797

（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11月11日から2021年5月10日まで、及び2021年5月11日から2021年11月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種　類	2021年5月10日 現在				2021年11月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 不動産投信 指数先物取引 買　建	2,124,472,000	－	2,306,448,000	181,976,000	2,577,120,000	－	2,465,400,000	△111,720,000
合計	2,124,472,000	－	2,306,448,000	181,976,000	2,577,120,000	－	2,465,400,000	△111,720,000

（注）　1．時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4325円 (34,325円)	3.5243円 (35,243円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額（円）	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	4,288	602,464,000	
	サンケイリアルエステート	5,714	699,965,000	
	東海道リート投資法	2,399	259,331,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人	5,768	3,656,912,000	
	森ヒルズリート	27,892	4,339,995,200	
	産業ファンド	12,343	2,557,469,600	
	アドバンス・レジデンス	7,350	2,653,350,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	14,981	3,240,390,300	
	ＡＰＩ投資法人	5,557	2,528,435,000	
	ＧＬＰ投資法人	43,062	7,936,326,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	7,703	2,499,623,500	
	日本プロロジスリート	15,647	5,812,860,500	
	ＯＮＥリート投資法人	1,047	312,738,900	
	イオンリート投資	18,084	2,795,786,400	
	ヒューリックリート投資法	11,957	2,044,647,000	
	日本リート投資法人	4,194	1,797,129,000	
	積水ハウス・リート投資	33,656	2,870,856,800	
	トーセイ・リート投資法人	2,246	297,819,600	
	ケネディクス商業リート	3,708	1,062,712,800	
	ヘルスケア&メディカル投資	968	156,235,200	
	野村不動産マスターＦ	37,631	6,273,087,700	
	ラサールロジポート投資	20,297	3,870,637,900	
	三井不ロジパーク	4,650	2,734,200,000	
	三菱地所物流REIT	7,682	3,687,360,000	
	ザイマックス・リート	5,956	695,065,200	
	日本ビルファンド	12,273	8,738,376,000	※
	ジャパンリアルエステイト	12,508	8,517,948,000	※
	日本都市ファンド投資法人	56,139	5,698,108,500	
	オリックス不動産投資	19,155	3,482,379,000	
	日本プライムリアルティ	5,567	2,310,305,000	
	NTT都市開発リート投資法人	3,647	555,073,400	

	東急リアル・エステート	5,646	1,067,094,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	9,398	1,114,602,800	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	32,120	4,577,100,000	
	森トラスト総合リート	4,386	641,233,200	
	インヴィンシブル投資法人	52,678	2,288,859,100	
	フロンティア不動産投資	3,460	1,764,600,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,487	1,816,197,000	
	福岡リート投資法人	7,305	1,235,275,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	4,475	3,172,775,000	
	いちごオフィスリート投資法人	13,541	1,167,234,200	
	大和証券オフィス投資法人	2,210	1,617,720,000	
	大和ハウスリート投資法人	16,967	5,514,275,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	22,126	1,478,016,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	10,148	1,417,675,600	
投資証券　合計			123,560,248,200	
合計			123,560,248,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　700口　ジャパンリアルエステイト　1,000口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	72,277,932	78,290,327
コール・ローン	2,298,235	119,272,457
株式	2,986,965,744	3,188,202,385

ハイブリッド優先証券	500,345,277	666,176,711
投資証券	22,938,913	23,673,175
派生商品評価勘定	110,700	―
未収入金	15,391,895	68,696,017
未収配当金	2,728,341	2,359,216
未収利息	1,082,182	1,029,604
流動資産合計	3,604,139,219	4,147,699,892
資産合計	3,604,139,219	4,147,699,892
負債の部		
流動負債		
未払金	―	7,951,608
未払解約金	6,144,000	3,895,000
その他未払費用	25	―
流動負債合計	6,144,025	11,846,608
負債合計	6,144,025	11,846,608
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	921,277,703	944,385,941
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,676,717,491	3,191,467,343
元本等合計	3,597,995,194	4,135,853,284
純資産合計	3,597,995,194	4,135,853,284
負債純資産合計	3,604,139,219	4,147,699,892

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5月11日 至　2021年11月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)ハイブリッド優先証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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	(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。
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5月10日現在	2021年11月10日現在
1．※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	952,462,833円	921,277,703円
期中追加設定元本額	26,052,283円	58,681,824円
期中一部解約元本額	57,237,413円	35,573,586円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,004,965円	5,037,046円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	5,290,592円	4,572,820円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	100,250,925円	84,676,076円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	16,696,307円	14,469,451円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	17,282,015円	14,383,744円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	128,529,147円	129,816,220円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	236,889,487円	246,065,781円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	410,334,265円	445,364,803円
計	921,277,703円	944,385,941円
2.　期末日における受益権の総数	921,277,703口	944,385,941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5月11日 至　2021年11月10日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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11月10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5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	68,553,394	151,303,761
ハイブリッド優先証券	1,379,863	804,974
投資証券	131,002	△44,185
合計	70,064,259	152,064,550

（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（2021年4月16日から2021年5月10日まで、及び2021年10月16日から2021年11月10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5月10日 現在				2021年11月10日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	32,741,400	－	32,630,700	110,700	－	－	－	－
アメリカ・ドル	32,741,400	－	32,630,700	110,700	－	－	－	－
合計	32,741,400	－	32,630,700	110,700	－	－	－	－

（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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.9054円 (39,054円)	4.3794円 (43,794円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通 貨	銘 柄	株 式 数	評価額		備考
			単 価	金 額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	ABBOTT LABORATORIES	2,461	126.430	311,144.230	
	ADOBE INC	818	667.920	546,358.560	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,272	313.840	399,204.480	
	ALBEMARLE CORP	606	274.570	166,389.420	
	DANAHER CORP	1,220	299.190	365,011.800	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,434	135.480	465,238.320	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	8,574	64.430	552,422.820	
	TE CONNECTIVITY LTD	983	161.060	158,321.980	
	APPLE INC	9,188	150.810	1,385,642.280	
	BOEING CO/THE	1,263	220.790	278,857.770	
	NISOURCE INC	14,760	25.030	369,442.800	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,153	52.240	634,872.720	

JPMORGAN CHASE & CO	5,570	167.780	934,534.600	
CATERPILLAR INC	1,378	209.810	289,118.180	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,385	47.250	396,191.250	
MORGAN STANLEY	3,767	99.710	375,607.570	
BROADCOM INC	1,228	557.800	684,978.400	
DEERE & CO	824	355.810	293,187.440	
TELEFLEX INC	528	342.320	180,744.960	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,722	78.050	134,402.100	
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,947	67.100	197,743.700	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,114	276.550	308,076.700	
AMAZON.COM INC	259	3,576.230	926,243.570	
EOG RESOURCES INC	2,242	97.110	217,720.620	
FORD MOTOR CO	10,011	20.120	201,421.320	
NEXTERA ENERGY INC	3,286	84.940	279,112.840	
GENERAL ELECTRIC CO	1,325	111.290	147,459.250	
GENERAL MOTORS CO	3,878	58.620	227,328.360	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	920	405.350	372,922.000	
ALPHABET INC-CL A	131	2,978.370	390,166.470	
HOME DEPOT INC	817	370.650	302,821.050	
JOHNSON & JOHNSON	2,977	162.510	483,792.270	
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	9,723	57.290	557,030.670	
MCDONALD'S CORP	1,355	252.650	342,340.750	
META PLATFORMS INC CLASS A	1,753	335.370	587,903.610	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,296	249.430	323,261.280	
MERCK & CO. INC.	2,092	82.720	173,050.240	
NIKE INC -CL B	1,197	173.820	208,062.540	
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,990	284.600	566,354.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	790	364.520	287,970.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,592	93.670	242,792.640	
PFIZER INC	9,943	47.300	470,303.900	
DOW INC	9,163	58.790	538,692.770	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,032	145.390	150,042.480	
TESLA INC	302	1,023.500	309,097.000	
ORGANON & CO	209	36.640	7,657.760	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,275	209.960	477,659.000	
ANTHEM INC	421	430.120	181,080.520	
WALT DISNEY CO/THE	1,801	175.110	315,373.110	
WASTE MANAGEMENT INC	2,425	159.580	386,981.500	

	WALMART INC	852	149.790	127,621.080	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	532	595.720	316,923.040	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,367	233.380	319,030.460	
	VISA INC-CLASS A SHARES	3,561	213.390	759,881.790	
	NVIDIA CORP	1,372	306.570	420,614.040	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,151	207.040	445,343.040	
	TYSON FOODS INC-CL A	5,086	81.520	414,610.720	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	760	618.580	470,120.800	
	MASTERCARD INC - A	2,310	344.650	796,141.500	
	BANK OF AMERICA CORP	13,130	46.880	615,534.400	
	EATON CORP PLC	2,509	174.660	438,221.940	
	ECOLAB INC	1,024	230.950	236,492.800	
	INTEL CORP	3,089	51.200	158,156.800	
	MICROSOFT CORP	4,599	335.950	1,545,034.050	
	MEDTRONIC PLC	3,178	122.290	388,637.620	
	MICRON TECHNOLOGY INC	10,702	75.590	808,964.180	
	COMCAST CORP-CLASS A	4,220	53.750	226,825.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 27,590,287.660 (3,113,839,866)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	19,228	32.670	628,178.760	
	ENBRIDGE INC	3,643	52.620	191,694.660	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 819,873.420 (74,362,519)	
合計				3,188,202,385 [3,188,202,385]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		CHS INC 7.5 4	4,575.000	133,498.500	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2,558.000	73,286.700	

ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	30,444.000	
MORGAN STANLEY 5.85 K	633.000	18,654.510	
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	4,465.000	112,696.600	
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2,582.000	66,409.040	
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2,076.000	54,391.200	
SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	52,123.380	
ENBRIDGE INC 6.375 B	497.000	13,433.910	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2,725.000	72,512.250	
UNUM GROUP 6.25	3,350.000	90,316.000	
KEYCORP 5.65 F	952.000	26,122.880	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	2,235.000	61,149.600	
NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	80,450.300	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2,328.000	64,764.960	
CMS ENERGY CORP 5.875	4,546.000	126,242.420	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,367.000	39,615.660	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	909.000	25,370.190	
SPIRE INC 5.9 A	3,556.000	99,390.200	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100.000	32,890.000	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	4,851.000	130,055.310	
ALLSTATE CORP 5.1 H	6,144.000	168,407.040	
SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	178,819.370	
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1,923.000	50,978.730	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6,414.000	173,562.840	
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	9,130.000	245,688.300	
SOUTHERN CO 4.95 2020	8,035.000	217,427.100	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	12,614.000	329,477.680	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	9,066.000	237,483.870	
FIRST HORIZON CORP 6.5	3,936.000	111,349.440	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	5,778.000	167,504.220	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	5,735.000	153,124.500	

		UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2,438.000	66,350.170	
		BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167.000	81,486.910	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	8,422.000	220,319.520	
		BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	6,161.000	164,129.040	
		US CELLULAR CORP 5.5	1,667.000	44,308.860	
		WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	5,182.000	131,208.240	
		WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	6,503.000	173,955.250	
		FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10,983.000	295,003.380	
		TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	4,979.000	138,167.250	
		TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	5,524.000	148,153.680	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	2,508.000	66,060.720	
		CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	2,640.000	69,643.200	
		FIRST HORIZON CORP 4.7 F	4,185.000	107,931.150	
		REGIONS FINANCIAL CORP 4.45 E	1,326.000	33,779.850	
		JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	4,467.000	117,616.110	
		HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C	400.000	10,648.000	
		ATHENE HOLDING LTD 4.875 D	5,141.000	133,666.000	
		JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2	1,197.000	30,200.310	
		MORGAN STANLEY 4.25	5,611.000	142,014.410	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589.000	44,737.500	
		REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	3,022.000	88,484.160	
		PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,290.000	33,101.400	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	1,593.000	45,703.170	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	2,892.000	78,373.200	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 5,902,682.180	

				(666,176,711)	
ハイブリッド優先証券　合計				666,176,711 [666,176,711]	
投資証券	アメリカ・ドル	UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1,200	アメリカ・ドル 31,020.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	2,875	73,255.000	
		SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1,350	34,857.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIE 4.75	2,825	70,625.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 209,757.000 (23,673,175)	
投資証券　合計				23,673,175 [23,673,175]	
合計				689,849,886 [689,849,886]	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入ハイブリッド優先証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式　67銘柄 ハイブリッド優先証券　56銘柄 投資証券　4銘柄	81.9%	17.5%	0.6%	98.1%
カナダ・ドル	株式　2銘柄	100%	-%	-%	1.9%

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

該当事項はありません。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	9,827,236	29,610,027
コール・ローン	7,346,015	22,718,337
株式	1,389,065,093	1,423,287,132
未収配当金	6,563,470	680,010
流動資産合計	1,412,801,814	1,476,295,506
資産合計	1,412,801,814	1,476,295,506
負債の部		
流動負債		
未払解約金	562,000	6,651,000
その他未払費用	11	―
流動負債合計	562,011	6,651,000
負債合計	562,011	6,651,000
純資産の部		
元本等		
元本　※1	702,513,696	688,288,869
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	709,726,107	781,355,637
元本等合計	1,412,239,803	1,469,644,506
純資産合計	1,412,239,803	1,469,644,506
負債純資産合計	1,412,801,814	1,476,295,506

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5月11日 至　2021年11月10日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1．※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日

期首元本額	764,574,485円	702,513,696円
期中追加設定元本額	22,828,119円	37,440,804円
期中一部解約元本額	84,888,908円	51,665,631円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	11,922,060円	10,479,745円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	10,373,914円	9,425,055円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	196,739,306円	173,684,050円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	32,642,504円	28,728,735円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	34,214,037円	29,372,252円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	69,200,438円	69,224,048円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	127,410,420円	130,813,795円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	220,011,017円	236,561,189円
計	702,513,696円	688,288,869円
2.　期末日における受益権の総数	702,513,696口	688,288,869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5月11日 至　2021年11月10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11月10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5月10日現在	2021年11月10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	12,050,173	48,907,294
合計	12,050,173	48,907,294

（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（2021年4月16日から2021年5月10日まで、及び2021年10月16日から2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0103円 (20,103円)	2.1352円 (21,352円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	UNILEVER PLC	4,489	39.075	175,407.670	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	14.800	219,691.200	
	AVIVA PLC	40,669	3.952	160,723.880	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	15.598	248,008.200	
	M&G PLC	68,765	1.962	134,916.930	
	TESCO PLC	88,445	2.785	246,319.320	
	VODAFONE GROUP PLC	101,657	1.117	113,632.190	
	NATIONAL GRID PLC	17,873	9.426	168,470.890	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	4.297	186,506.980	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	16.770	197,231.970	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 1,850,909.230 (283,133,585)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,313	367.150	482,067.950	
	NESTLE SA-REG	5,578	122.960	685,870.880	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	903	408.700	369,056.100	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	75.880	333,037.320	
	GIVAUDAN-REG	95	4,399.000	417,905.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 2,287,937.250 (283,361,029)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,486	196.750	489,120.500	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 489,120.500 (6,436,825)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	145.700	407,960.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	90.660	271,617.360	

	BASF SE	3,676	61.710	226,845.960	
	ALLIANZ SE-REG	1,145	203.300	232,778.500	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,037	253.950	263,346.150	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	16.538	349,696.010	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,823	56.310	384,203.130	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	7,785	41.510	323,155.350	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	28.530	185,616.180	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,117	190.200	402,653.400	
	KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.614	229,846.400	
	TOTALENERGIES SE	6,299	43.535	274,226.960	
	MICHELIN (CGDE)	2,155	135.400	291,787.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,895	154.280	446,640.600	
	BNP PARIBAS	3,990	58.870	234,891.300	
	CAPGEMINI SE	1,883	212.200	399,572.600	
	AXA SA	12,126	25.355	307,454.730	
	SANOFI	3,893	88.610	344,958.730	
	INTESA SANPAOLO	100,555	2.470	248,421.120	
	ENI SPA	12,935	12.620	163,239.700	
	ENEL SPA	48,153	7.094	341,597.380	
	ENAGAS SA	8,545	19.800	169,191.000	
ユーロ　小計				ユーロ 6,499,699.560 (850,355,693)	
合計				1,423,287,132 [1,423,287,132]	

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
イギリス・ポンド	株式　10銘柄	100%	19.9%
スイス・フラン	株式　5銘柄	100%	19.9%
スウェーデン・クローナ	株式　1銘柄	100%	0.5%
ユーロ	株式　22銘柄	100%	59.7%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	―	24,485,668
コール・ローン	14,912,191	5,102,174
株式	697,352,371	670,934,597
未収入金	14,642,002	―
未収配当金	275,514	1,374,086
流動資産合計	727,182,078	701,896,525
資産合計	727,182,078	701,896,525
負債の部		
流動負債		
前受金	1,070,064	―
未払金	1,574,070	6,357,574
未払解約金	8,159,000	106,000
その他未払費用	3	―
流動負債合計	10,803,137	6,463,574
負債合計	10,803,137	6,463,574
純資産の部		
元本等		
元本　※1	241,044,350	244,476,014
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	475,334,591	450,956,937
元本等合計	716,378,941	695,432,951
純資産合計	716,378,941	695,432,951
負債純資産合計	727,182,078	701,896,525

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5月11日 至　2021年11月10日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1.　※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	306,837,536円	241,044,350円
期中追加設定元本額	3,018,649円	14,141,147円
期中一部解約元本額	68,811,835円	10,709,483円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,871,791円	7,882,565円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,771,731円	7,116,298円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	129,233,822円	129,622,989円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	22,011,268円	20,994,790円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	22,722,060円	22,036,357円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	8,682,376円	8,961,574円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	16,088,006円	17,059,722円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	27,663,296円	30,801,719円
計	241,044,350円	244,476,014円
2.　期末日における受益権の総数	241,044,350口	244,476,014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5月11日 至　2021年11月10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11月10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5月10日現在	2021年11月10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	4,782,172	18,588,798
合計	4,782,172	18,588,798

（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（2021年4月16日から2021年5月10日まで、及び2021年10月16日から2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9720円 (29,720円)	2.8446円 (28,446円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)　株式

通　貨	銘　柄	株　式　数	評価額		備考
			単　価	金　額	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP GROUP LTD	6,700	36.730	246,091.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	3,400	22.980	78,132.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	13,900	28.890	401,571.000	
	WESTPAC BANKING CORP	9,600	22.520	216,192.000	
	RIO TINTO LTD	700	88.980	62,286.000	
	OIL SEARCH LTD	18,700	4.280	80,036.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,350	108.810	473,323.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,000	200.000	200,000.000	
	CSL LTD	500	314.880	157,440.000	
	WESFARMERS LTD	4,700	59.850	281,295.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 2,196,366.500 (182,759,657)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	23,900	3.450	82,455.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,800	32.300	187,340.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	4.380	74,460.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 344,255.000 (28,845,126)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA CORP	700	87,000.000	60,900,000.000	
	SK HYNIX INC	2,000	109,000.000	218,000,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	500	213,000.000	106,500,000.000	
	POSCO	330	285,000.000	94,050,000.000	
	HYUNDAI MOBIS CO LTD	230	248,500.000	57,155,000.000	
	E-MART INC	400	164,500.000	65,800,000.000	
	NAVER CORP	390	417,500.000	162,825,000.000	
	LG CHEM LTD	90	769,000.000	69,210,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	3,500	55,800.000	195,300,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,900	70,500.000	486,450,000.000	
	SK TELECOM	200	309,500.000	61,900,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	3,400	44,200.000	150,280,000.000	
韓国・ウォン　小計				韓国・ウォン 1,728,370,000.000 (165,577,846)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,000	98.850	593,100.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,500	465.000	1,162,500.000	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	23,000	8.180	188,140.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	143,000	5.220	746,460.000	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	62,200	5.250	326,550.000	
	AIA GROUP LTD	22,000	85.600	1,883,200.000	
	SANDS CHINA LTD	20,800	18.100	376,480.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	5,500	161.200	886,600.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	13.680	164,160.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	10.600	190,800.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	13,500	62.750	847,125.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 7,365,115.000 (106,720,516)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	384.000	1,152,000.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	767.000	1,534,000.000	

	DELTA ELECTRONICS INC	3,000	266.000	798,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	68.700	687,000.000	
	MEDIATEK INC	6,000	978.000	5,868,000.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	85,000	33.700	2,864,500.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	141,000	23.550	3,320,550.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3,000	461.000	1,383,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	349.000	1,396,000.000	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	285.000	3,135,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	26,000	611.000	15,886,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	23,000	108.000	2,484,000.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	87,000	63.100	5,489,700.000	
台湾・ドル　小計				台湾・ドル 45,997,750.000 (187,031,452)	
合計				670,934,597 [670,934,597]	

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
オーストラリア・ドル	株式　10銘柄	100%	27.2%
シンガポール・ドル	株式　3銘柄	100%	4.3%
韓国・ウォン	株式　12銘柄	100%	24.7%
香港・ドル	株式　11銘柄	100%	15.9%
台湾・ドル	株式　13銘柄	100%	27.9%

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

該当事項はありません。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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5月10日現在	2021年11月10日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	260,527,247	784,534,044
株式	15,788,191,810	14,890,080,750
未収入金	―	51,419,331
未収配当金	208,463,150	184,959,000
流動資産合計	16,257,182,207	15,910,993,125
資産合計	16,257,182,207	15,910,993,125
負債の部		
流動負債		
未払金	38,446,081	43,493,296
未払解約金	12,500,000	12,913,000
その他未払費用	154	―
流動負債合計	50,946,235	56,406,296
負債合計	50,946,235	56,406,296
純資産の部		
元本等		
元本　※1	4,899,243,243	4,598,298,795
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,306,992,729	11,256,288,034
元本等合計	16,206,235,972	15,854,586,829
純資産合計	16,206,235,972	15,854,586,829
負債純資産合計	16,257,182,207	15,910,993,125

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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1．※1　期首	2020年11月11日	2021年5月11日
期首元本額	5,728,483,009円	4,899,243,243円
期中追加設定元本額	89,044,701円	200,758,486円
期中一部解約元本額	918,284,467円	501,702,934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）	3,132,711,213円	2,778,124,083円
ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）	24,345,037円	23,473,831円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	21,868,621円	19,842,510円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,344,109円	18,171,934円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	361,317,803円	318,727,182円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	58,855,460円	51,204,498円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	62,096,019円	55,008,509円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	199,577,941円	209,602,028円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	370,252,950円	399,148,880円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	648,874,090円	724,995,340円
計	4,899,243,243円	4,598,298,795円
2.　期末日における受益権の総数	4,899,243,243口	4,598,298,795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5月11日 至　2021年11月10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11月10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5月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月10日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	196,000,211	52,355,672
合計	196,000,211	52,355,672

（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（2021年4月16日から2021年5月10日まで、及び2021年10月16日から2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10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5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.3079円 (33,079円)	3.4479円 (34,479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	294,400	269.00	79,193,600	
住友林業	22,600	2,326.00	52,567,600	
大和ハウス	34,400	3,463.00	119,127,200	
エクシオグループ	26,600	2,665.00	70,889,000	
九電工	29,300	3,500.00	102,550,000	
ブルボン	22,400	2,239.00	50,153,600	
日鉄ソリューションズ	1,000	3,530.00	3,530,000	
ディップ	32,000	4,225.00	135,200,000	
アサヒグループホールディン	23,700	4,919.00	116,580,300	
エレマテック	21,700	1,086.00	23,566,200	
パルグループＨＬＤＧＳ	67,300	1,666.00	112,121,800	

太陽化学	22,300	1,740.00	38,802,000	
日本たばこ産業	34,400	2,326.00	80,014,400	
アルコニックス	32,200	1,598.00	51,455,600	
富士紡ホールディングス	16,100	4,045.00	65,124,500	
ダイワボウＨＤ	96,500	1,852.00	178,718,000	
レスターホールディングス	11,100	1,887.00	20,945,700	
ＴＯＫＡＩホールディングス	184,600	866.00	159,863,600	
三洋貿易	84,000	1,015.00	85,260,000	
帝国繊維	15,100	2,073.00	31,302,300	
旭　化　成	260,200	1,148.00	298,709,600	
川田テクノロジーズ	12,700	3,835.00	48,704,500	
ハウスドゥ	46,800	959.00	44,881,200	
コメダホールディングス	31,600	2,033.00	64,242,800	
共和レザー	64,400	661.00	42,568,400	
セーレン	40,600	2,285.00	92,771,000	
ワコールホールディングス	51,300	2,185.00	112,090,500	
ＳＲＡホールディングス	7,500	2,920.00	21,900,000	
昭和電工	27,800	2,728.00	75,838,400	
日本曹達	30,900	3,320.00	102,588,000	
大阪ソーダ	21,200	2,686.00	56,943,200	
信越化学	8,800	19,870.00	174,856,000	
エア・ウォーター	74,300	1,803.00	133,962,900	
四国化成	45,200	1,420.00	64,184,000	
東京応化工業	10,900	7,380.00	80,442,000	
旭有機材	29,900	1,450.00	43,355,000	
第一工業製薬	45,300	3,365.00	152,434,500	
武田薬品	75,400	3,232.00	243,692,800	
日本空調サービス	74,600	796.00	59,381,600	
伊藤忠テクノソリュー	29,200	3,725.00	108,770,000	
フルキャストホールディングス	38,700	2,792.00	108,050,400	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	43,200	9,118.00	393,897,600	
デクセリアルズ	126,600	3,310.00	419,046,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	48,300	1,871.00	90,369,300	
ＡＧＣ	77,200	5,700.00	440,040,000	
ニチアス	50,700	2,640.00	133,848,000	
日本製鉄	72,300	1,891.50	136,755,450	
日本冶金工	23,800	2,228.00	53,026,400	
三菱製鋼	30,100	1,017.00	30,611,700	
三井金属	37,300	3,055.00	113,951,500	
三和ホールディングス	91,600	1,275.00	116,790,000	

日東精工	77,400	643.00	49,768,200	
マルゼン	30,900	2,223.00	68,690,700	
ファインシンター	18,900	1,542.00	29,143,800	
ソデイツク	84,400	869.00	73,343,600	
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	72,100	1,390.00	100,219,000	
豊田自動織機	16,400	9,800.00	160,720,000	
フリュー	45,400	1,592.00	72,276,800	
サトーホールディングス	17,000	2,606.00	44,302,000	
三精テクノロジーズ	28,500	820.00	23,370,000	
キトー	56,600	1,721.00	97,408,600	
日　立	88,500	7,014.00	620,739,000	
富士電機	57,100	5,670.00	323,757,000	
ＩＤＥＣ	14,100	2,537.00	35,771,700	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	33,900	4,470.00	151,533,000	
デンソー	29,800	8,241.00	245,581,800	
村田製作所	17,700	8,425.00	149,122,500	
ＩＨＩ	68,400	2,563.00	175,309,200	
プレミアグループ	60,400	3,795.00	229,218,000	
いすゞ自動車	172,700	1,575.00	272,002,500	
トヨタ自動車	243,500	2,005.50	488,339,250	
プレス工業	116,000	410.00	47,560,000	
ミクニ	67,400	319.00	21,500,600	
萩原電気ＨＬＤＧＳ	17,300	2,205.00	38,146,500	
コ　ジ　マ	77,000	576.00	44,352,000	
アルゴグラフィックス	31,100	3,070.00	95,477,000	
ダイトロン	42,500	2,108.00	89,590,000	
スター精密	52,500	1,492.00	78,330,000	
フジシールインターナショナル	49,400	2,465.00	121,771,000	
大日本印刷	119,900	2,822.00	338,357,800	
藤森工業	10,000	4,740.00	47,400,000	
リンテック	22,400	2,513.00	56,291,200	
信越ポリマー	123,700	1,029.00	127,287,300	
伊　藤　忠	46,900	3,314.00	155,426,600	
東京エレクトロン	6,600	56,000.00	369,600,000	
スターゼン	20,800	2,064.00	42,931,200	
セイコーＨＤ	38,900	2,211.00	86,007,900	
日本ユニシス	48,900	3,410.00	166,749,000	
三菱商事	92,700	3,355.00	311,008,500	
稲畑産業	40,800	1,602.00	65,361,600	
しまむら	17,500	9,740.00	170,450,000	

丸井グループ	36,400	2,220.00	80,808,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	609,200	630.00	383,796,000	
三井住友フィナンシャルＧ	95,400	3,790.00	361,566,000	
ＳＢＩホールディングス	35,600	2,785.00	99,146,000	
オリックス	181,800	2,274.00	413,413,200	
ＭＳ＆ＡＤ	52,200	3,652.00	190,634,400	
第一生命ＨＬＤＧＳ	78,900	2,396.50	189,083,850	
東京海上ＨＤ	67,300	5,916.00	398,146,800	
東京建物	80,600	1,629.00	131,297,400	
山　九	18,700	4,750.00	88,825,000	
丸全昭和運輸	13,800	3,445.00	47,541,000	
センコーグループＨＬＤＧＳ	140,300	985.00	138,195,500	
三井倉庫ＨＯＬＤ	54,600	2,362.00	128,965,200	
日本電信電話	49,600	3,225.00	159,960,000	
ＫＤＤＩ	108,600	3,415.00	370,869,000	
シーイーシー	27,500	1,356.00	37,290,000	
日本管財	5,900	2,756.00	16,260,400	
日鉄物産	28,000	4,800.00	134,400,000	
合計			14,890,080,750	

(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。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2021年5月11日から2021年11月10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】

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,700,500	10,988,844
親投資信託受益証券	628,425,968	620,112,154
未収入金	2,000,000	―
流動資産合計	639,126,468	631,100,998
資産合計	639,126,468	631,100,998
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	988,948	971,122
未払解約金	1,754,418	―
未払受託者報酬	58,025	57,488
未払委託者報酬	1,421,944	1,408,771
その他未払費用	25,858	26,118
流動負債合計	4,249,193	2,463,499
負債合計	4,249,193	2,463,499
純資産の部		
元本等		
元本	※1 659,299,102	※1 647,415,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 24,421,827	※2 △ 18,777,537
（分配準備積立金）	21,689,758	21,892,069
元本等合計	634,877,275	628,637,499
純資産合計	634,877,275	628,637,499
負債純資産合計	639,126,468	631,100,998

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10日
営業収益		
受取利息	1	―
有価証券売買等損益	59,294,769	12,686,186
営業収益合計	59,294,770	12,686,186
営業費用		
支払利息	663	1,073
受託者報酬	172,869	174,719
委託者報酬	※1 4,236,103	※1 4,281,475
その他費用	25,858	26,118
営業費用合計	4,435,493	4,483,385
営業利益	54,859,277	8,202,801
経常利益	54,859,277	8,202,801
当期純利益	54,859,277	8,202,801
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	620,789	△ 5,237
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 81,667,657	△ 24,421,827
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,520,399	866,552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,520,399	866,552
剰余金減少額又は欠損金増加額	461,401	510,164
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	461,401	510,164
分配金	※2 3,051,656	※2 2,920,136
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 24,421,827	△ 18,777,537

(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5月11日 至　2021年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
1.　※1　期首元本額	725,320,563円	659,299,102円
期中追加設定元本額	5,581,535円	14,180,659円
期中一部解約元本額	71,602,996円	26,064,725円
2.　特定期間末日における受益権の総数	659,299,102口	647,415,036口
3.　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は24,421,827円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は18,777,537円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10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	180,098円	180,593円

2．※2　分配金の計算過程	（自2020年11月11日　至2021年1月12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（1,969,131円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,203,869円）及び分配準備積立金（19,767,237円）より分配対象額は22,940,237円（1万口当たり325.85円）であり、うち1,056,002円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2021年1月13日　至2021年3月10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（1,892,239円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,176,158円）及び分配準備積立金（19,687,032円）より分配対象額は22,755,429円（1万口当たり339.06円）であり、うち1,006,706円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年7月12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（1,596,398円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,251,905円）及び分配準備積立金（21,411,122円）より分配対象額は24,259,425円（1万口当たり371.53円）であり、うち979,450円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （自2021年7月13日　至2021年9月10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（1,001,979円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,464,383円）及び分配準備積立金（21,585,854円）より分配対象額は24,052,216円（1万口当たり372.11円）であり、うち969,564円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	

	（自2021年3月11日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,503,798円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,191,884円）及び分配準備積立金（20,174,908円）より分配対象額は23,870,590円（1万口当たり362.06円）であり、うち988,948円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	（自2021年9月11日　至2021年11月10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（1,390,359円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,653,297円）及び分配準備積立金（21,472,832円）より分配対象額は24,516,488円（1万口当たり378.68円）であり、うち971,122円（1万口当たり15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5月11日 至　2021年11月10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11月10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	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
	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	21,634,363	3,503,366
合計	21,634,363	3,503,366

（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5月10日現在	当　期 2021年11月10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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9630円 (9,630円)	0.9710円 (9,710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	228,873,956	435,684,462	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	8,582,433	31,044,376	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	18,171,934	62,655,011	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	4,572,820	20,026,207	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	9,425,055	20,124,377	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	7,116,298	20,243,021	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	8,607,298	30,334,700	
親投資信託受益証券　合計			620,112,154	
合計			620,112,154	

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、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日（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

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2021年5月11日から2021年11月10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】

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	112,096,314	111,338,609
親投資信託受益証券	3,365,944,146	3,159,300,882
未収入金	10,000,000	10,000,000
流動資産合計	3,488,040,460	3,280,639,491
資産合計	3,488,040,460	3,280,639,491
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	80,593,017	77,945,724
未払解約金	3,385,261	8,576,016
未払受託者報酬	318,383	298,775
未払委託者報酬	8,278,331	7,768,615
その他未払費用	138,702	136,967
流動負債合計	92,713,694	94,726,097
負債合計	92,713,694	94,726,097
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,223,720,688	※1 3,117,828,980
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	171,606,078	68,084,414
（分配準備積立金）	305,211,917	193,012,862
元本等合計	3,395,326,766	3,185,913,394
純資産合計	3,395,326,766	3,185,913,394
負債純資産合計	3,488,040,460	3,280,639,491

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10日
営業収益		
受取利息	5	―
有価証券売買等損益	619,347,673	130,356,736
営業収益合計	619,347,678	130,356,736
営業費用		
支払利息	3,318	5,456
受託者報酬	925,133	913,707
委託者報酬	※1 24,054,698	※1 23,757,557
その他費用	138,702	136,967
営業費用合計	25,121,851	24,813,687
営業利益	594,225,827	105,543,049
経常利益	594,225,827	105,543,049
当期純利益	594,225,827	105,543,049
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	8,483,947	△ 294,065
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 316,704,834	171,606,078
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,145,516	2,180,856
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,145,516	―
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	―	2,180,856
剰余金減少額又は欠損金増加額	609,900	7,099,667
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	―	7,099,667
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	609,900	―
分配金	※2 107,966,584	※2 204,439,967
期末剰余金又は期末欠損金（△）	171,606,078	68,084,414

(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5月11日 至　2021年11月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
1.　※1　期首元本額	3,608,417,895円	3,223,720,688円
期中追加設定元本額	24,319,139円	53,510,881円
期中一部解約元本額	409,016,346円	159,402,589円
2.　特定期間末日における受益権の総数	3,223,720,688口	3,117,828,980口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年11月11日 至　2021年5月10日	当　期 自　2021年5月11日 至　2021年11月10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	2,369,798円	2,330,701円

2．※2 分配金の計算過程	（自2020年11月11日　至2021年1月12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（8,773,716円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,084,803円）及び分配準備積立金（247,257,082円）より分配対象額は275,115,601円（1万口当たり788.97円）であり、うち13,948,085円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年7月12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（8,622,483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（13,208,298円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,636,025円）及び分配準備積立金（298,749,075円）より分配対象額は340,215,881円（1万口当たり1,073.30円）であり、うち79,244,923円（1万口当たり250円）を分配金額としております。	
	（自2021年1月13日　至2021年3月10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（11,800,479円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（18,983,779円）及び分配準備積立金（232,410,595円）より分配対象額は263,194,853円（1万口当たり784.17円）であり、うち13,425,482円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2021年7月13日　至2021年9月10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（9,627,489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（54,683,232円）、投資信託約款に規定される収益調整金（21,253,228円）及び分配準備積立金（238,103,121円）より分配対象額は323,667,070円（1万口当たり1,027.53円）であり、うち47,249,320円（1万口当たり150円）を分配金額としております。	

	（自2021年3月11日　至2021年5月10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（23,517,645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（140,943,575円）、投資信託約款に規定される収益調整金（18,570,213円）及び分配準備積立金（221,343,714円）より分配対象額は404,375,147円（1万口当たり1,254.37円）であり、うち80,593,017円（1万口当たり250円）を分配金額としております。	（自2021年9月11日　至2021年11月10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（13,106,324円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（6,589,288円）、投資信託約款に規定される収益調整金（22,368,055円）及び分配準備積立金（251,262,974円）より分配対象額は293,326,641円（1万口当たり940.80円）であり、うち77,945,724円（1万口当たり250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5月11日 至　2021年11月10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11月10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	前　期 2021年5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
	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	181,440,623	25,337,717
合計	181,440,623	25,337,717

（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5月10日現在	当　期 2021年11月10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5月11日 至　2021年11月10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5月10日現在	当　期 2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0532円 (10,532円)	1.0218円 (10,218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	333,789,213	635,401,145	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	43,868,174	158,679,958	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	318,727,182	1,098,939,450	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	84,676,076	370,830,407	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	173,684,050	370,850,183	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	129,622,989	368,725,554	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	44,228,410	155,874,185	
親投資信託受益証券　合計			3,159,300,882	
合計			3,159,300,882	

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、「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日（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

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

２【ファンドの現況】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	683,788,563円
Ⅱ	負債総額	1,174,433円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	682,614,130円
Ⅳ	発行済数量	700,719,594口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9742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11月30日

Ⅰ	資産総額	19,648,487,536円
Ⅱ	負債総額	29,581,220円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,618,906,316円
Ⅳ	発行済数量	10,474,003,907口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8731円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	149,861,944,331円
Ⅱ	負債総額	1,314,466,203円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	148,547,478,128円
Ⅳ	発行済数量	117,588,144,482口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2633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11月30日

Ⅰ	資産総額	101,412,310,330円
Ⅱ	負債総額	63,769,265円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	101,348,541,065円
Ⅳ	発行済数量	28,046,913,446口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6135円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	126,608,801,496円
Ⅱ	負債総額	947,460,109円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	125,661,341,387円
Ⅳ	発行済数量	36,522,408,645口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4407円

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	4,217,587,720円
Ⅱ	負債総額	95,920,386円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,121,667,334円
Ⅳ	発行済数量	940,561,072口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3821円

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	1,391,304,310円
Ⅱ	負債総額	0円

Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,391,304,310円
Ⅳ	発行済数量	684,670,573口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0321円

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	675,803,683円
Ⅱ	負債総額	2,000,000円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	673,803,683円
Ⅳ	発行済数量	242,296,583口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7809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11月30日

Ⅰ	資産総額	15,256,871,868円
Ⅱ	負債総額	92,446,395円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,164,425,473円
Ⅳ	発行済数量	4,567,572,316口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3200円

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	620,920,289円
Ⅱ	負債総額	486,361円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	620,433,928円
Ⅳ	発行済数量	651,348,578口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9525円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

Ⅰ	資産総額	3,092,707,456円
Ⅱ	負債総額	2,613,995円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,090,093,461円
Ⅳ	発行済数量	3,105,352,211口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9951円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年11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11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	60	175,229
追加型株式投資信託	772	21,068,563
株式投資信託　　合計	832	21,243,792
単位型公社債投資信託	78	215,962
追加型公社債投資信託	14	1,474,160
公社債投資信託　合計	92	1,690,122
総合計	924	22,933,914

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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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。

なお、当中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）は、改正府令附則第３条第１項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則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、第62期事業年度（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。

また、第63期事業年度に係る中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

３．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数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

<u>投資有価証券</u>

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。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2021年９月30日）
資産の部	
流動資産	
現金・預金	2,139
有価証券	250
未収委託者報酬	13,857
関係会社短期貸付金	16,300
その他	369
流動資産合計	32,916
固定資産	

有形固定資産	※1	211
無形固定資産		
ソフトウエア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2021年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	※2	927
流動負債合計		13,635
固定負債		
退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2
固定負債合計		2,571
負債合計		16,206
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	※１	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	※２	228
営業外費用	※３	87
経常利益		9,540
特別利益		―
特別損失	※４	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2021年４月１日 至　2021年９月30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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△9,388	△9,388	△9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△2,980	△2,980	△2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	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	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	△2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

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

中間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とおりであります。

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エアについては、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、支給見込額の当中間会計期間負担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中間会計期間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中間会計期間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中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

５．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。

６．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

７．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。

（会計方針の変更）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年３月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2021年９月30日現在）
有形固定資産	307百万円

※２　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

３　保証債務

当中間会計期間（2021年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30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	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 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

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月22日定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2021年９月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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、2019年７月４日公表の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、「2019年適用指針」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。

（１）時価をもって中間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）

	中間貸借対照表計上額			
	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）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって中間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、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、2019年適用指針第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格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中間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	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　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

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間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	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,179	3,398	△219
小計	3,179	3,398	△219
合計	10,956	9,294	1,661

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　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。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えており、かつ、内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

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］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

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中間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

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間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中間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、中間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］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30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］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

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］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,724.67円

１株当たり中間純利益	2,456.52円

（注１）　潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	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	株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	（注1）	
	寿証券株式会社	305百万円	（注1）	
	内藤証券株式会社	3,002百万円	（注1）	
	南都まほろば証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	ニュース証券株式会社	1,000百万円	（注1）	
	野村證券株式会社	10,000百万円	（注1）	
	松井証券株式会社	11,945百万円	（注1）	
	松阪証券株式会社	100百万円	（注1）	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	（注1）	
	楽天証券株式会社	7,495百万円	（注1）	
	岐阜信用金庫	20,800百万円	（注7）	(*1)
	株式会社きらやか銀行	24,200百万円	（注3）	
	株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	（注3）	
	株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	（注3）	
	湘南信用金庫	24,901百万円	（注7）	(*2)
	全国信用協同組合連合会	111,875百万円	（注5）	
	株式会社但馬銀行	5,481百万円	（注3）	
	株式会社東北銀行	13,233百万円	（注3）	
	株式会社東和銀行	38,653百万円	（注3）	
	株式会社栃木銀行	27,408百万円	（注3）	
	株式会社富山第一銀行	10,182百万円	（注3）	
	株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	（注3）	
	株式会社福島銀行	18,682百万円	（注3）	
	ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレイション・リミテッド（香港上海銀行）	※百万円	（注3）	(*3)

投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912ﾕｰﾛ （2020年12月31日現在）		
	コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	535千米ﾄﾞﾙ （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。
（*1）出資金を記載しています。
（*2）出資金を記載しています。
（*3）※１１６１億２４７万９４９５香港ドル、７１億９８００万米ドル（香港ドル建と米ドル建の株式が発行されており、合算せずに併記しております。）

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しています。
委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しています。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
・使用開始日を記載することがあります。
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
・次の事項を記載することがあります。
①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
・ファンドの形態等を記載することがあります。
・図案を採用することがあります。
・ファンドの管理番号等を記載することがあります。
・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2021年５月21日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月10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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

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」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年5月11日から2021年11月10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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月10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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

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」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年5月11日から2021年11月10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、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月10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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

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」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年5月11日から2021年11月10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、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2021年４月１日から2022年３月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。