

## 【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】	ダイワ・株 / 債券 / コモディティ・バランスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【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】

ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド（愛称：賢者のセオリー）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌々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】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。  
一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款(以下「目論見書等」といいます。 )において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

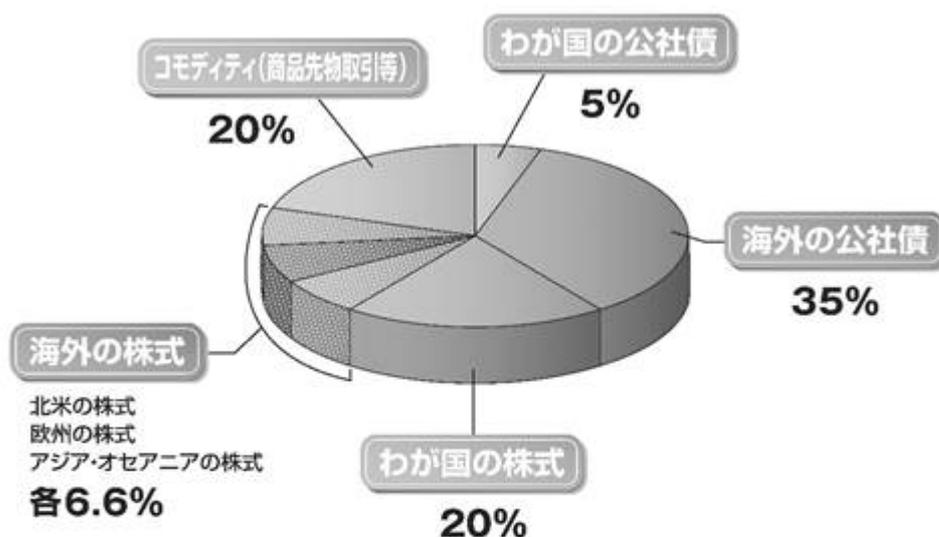
#### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

## 1 内外の公社債、内外の株式およびコモディティ(商品先物取引等)に投資します。

- 各資産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。



※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。

- 当ファンドは、以下の7本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

#### ■ 投資対象ファンド

- ①ダイワ日本国債マザーファンド
- ②ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
- ③ダイワ好配当日本株マザーファンド
- ④ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ⑤ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ⑥ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ⑦ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa "RICI" Fund」(以下「ダイワ "RICI" ファンド」といいます。)(米ドル建て)

## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の7本の投資信託証券への投資を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資します。



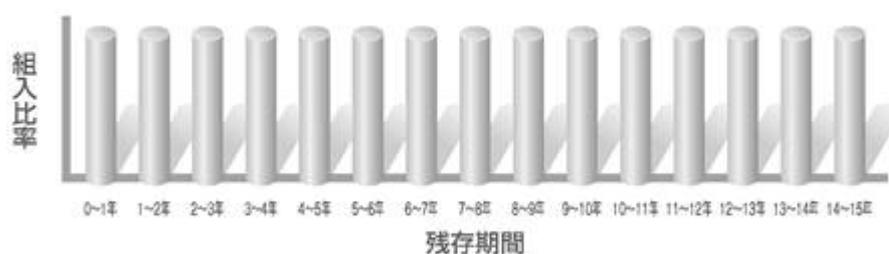
※くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

## 2

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、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。

## 3

## 海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

## ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

## 債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	S&Pの場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1, Aa2, Aa3 }	AA { AA+, AA, AA- }
	A { A1, A2, A3 }	A { A+, A, A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
	C	C
低い		D

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

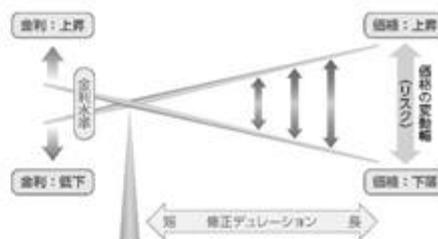
※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

- 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。

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

### 投資対象のイメージ



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

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

### 銘柄選定プロセス



## 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<sup>※</sup>を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

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

## 〈コーヘン&amp;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 コモディティ（商品先物取引等）への投資にあたっては、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“RICI”）に連動することをめざします。

- ダイワ“RICI”ファンドの信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。

### コモディティとは…

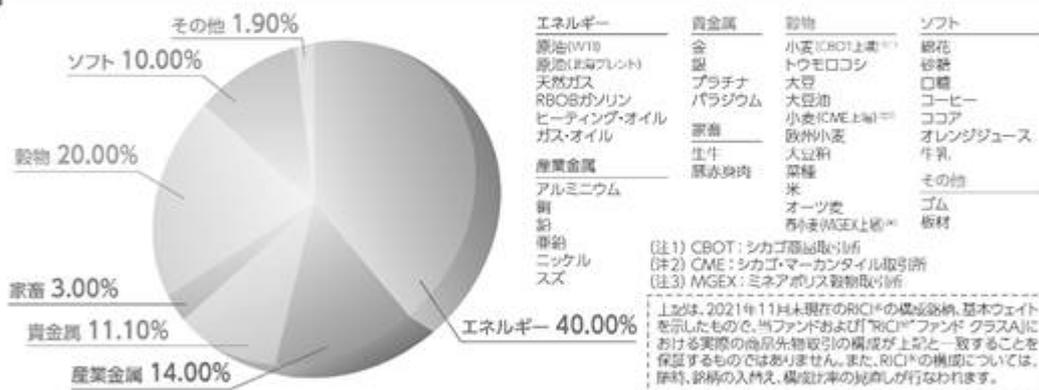
コモディティとは身近にあるさまざまな製品の原材料になるもので、主要な品目としては、原油や天然ガスなどの「エネルギー」、金・銀や銅・アルミニウムなどの「金属」、そして小麦・トウモロコシや生牛・豚赤身肉などの「農畜産物」などがあり、一般的に商品先物取引所に上場されています。

#### コモディティのイメージ



(注)上記のコモディティはあくまでも一例であり、他にもヒーティング・オイル、プラチナ、ニッケル、大豆、砂糖などがあります。

### RICI構成比率および構成銘柄



#### (RICI（ロジャーズ国際コモディティ指数）について…)

- RICIは、世界中の経済活動に広く利用されているコモディティ（商品）の値動きを表します。
- RICIは、1998年8月より計算および公表を行なっております。
- RICIを構成する品目とその比率は、ジム・ロジャーズが議長をつとめるRICI委員会において、各品目の需要見通しおよび先物市場の流動性等を勘案して決定されます。
- RICIは、投資可能性を考慮に入れた実用性の高い指数です。

「RICI構成比率および構成銘柄」の変更については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

#### 【注記】

[ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド(愛称:賢者のセオリー)]およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資信託「Daiwa “RICI” Fund」(以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。)はJames Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc. (以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。)により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Indexの決定、構成、算出において大和アセットマネジメント株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与していません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers」、「Rogers International Commodity Index」および「RICI」は、James Beeland Rogers, Jim RogersまたはBeeland Interests, Inc.のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

・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。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まる場合があります。

## 7

毎年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。

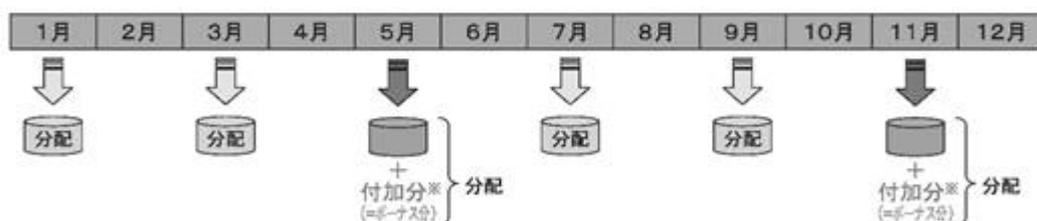
### 〈分配方針〉

- 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継続的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわない場合があります。

なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1万口当たり。以下同じ。）が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。

- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合…500円を上限とします。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合…1,000円を上限とします。

### 収益分配のイメージ



※5月と11月の付加額は、ゼロの場合があります。

- ◆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。

## 投資対象ファンドの概要

## I. タイワ日本国債マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	わが国の国債を投資対象とし、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。
投資態度	①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。 ②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。 ③国債の組入れは原則として高位を保ちます。 ④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。
信託期間	無期限（2005年3月29日当初設定）
決算日	毎年3月10日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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）

## Ⅱ. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	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。
投資態度	<p>①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。</p> <p>②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。</p> <p>イ. 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。</p> <p>※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</p> <p>ロ. 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。)</p> <p>ハ. 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&amp;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&amp;PでAA-以上)とすることを基本とします。</p> <p>ニ. 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。</p> <p>ホ. 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。</p> <p>③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。</p>
信託期間	無期限(2005年4月26日当初設定)
決算日	毎年4月10日および10月10日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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)

## Ⅲ. ダイワ好配当日本株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	<p>①主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)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。</p> <p>②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。</p> <p>③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>④J-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。</p>
信託期間	無期限(2005年7月11日当初設定)
決算日	毎年4月15日および10月15日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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)

## IV. ダイワ北米好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	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、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て運用を行ないます。
投資態度	①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。 ②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。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーペン&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。 ④株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ⑤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。
信託期間	無期限（2005年10月28日当初設定）
決算日	毎年4月15日および10月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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）

## V. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	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、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て運用を行ないます。
投資態度	①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。 ②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。 ③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。 ④株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ⑤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。
信託期間	無期限（2005年10月28日当初設定）
決算日	毎年4月15日および10月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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）

## VI. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

形態	証券投資信託／親投資信託
基本方針	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、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て運用を行ないます。
投資態度	①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。 ②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。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④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。
信託期間	無期限（2005年10月28日当初設定）
決算日	毎年4月15日および10月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	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。)および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
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）

## 【各マザーファンド共通】

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。

## VII. ダイワ "RICI" ファンド

形態／表示通貨	ケイマン籍の外国証券投資信託／米ドル建て
運用目的	当ファンドは、投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数("RICI")に連動することをめざします。
投資方針	<p>①信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数("RICI")に連動する投資成果をめざします。</p> <p>②米ドル建て短期公社債等への投資にあたっては、主に1年以内に償還を迎える米ドル建て短期公社債等に投資します。また、投資対象には、銀行引受手形、預託証書、コマーシャル・ペーパー、定期預金証書などへの投資も含まれますが、これに限定いたしません。</p> <p>③信託財産の純資産総額の50%未満の部分で商品先物取引および商品先渡取引に投資します。</p> <p>④当ファンドの純資産に占める、商品先物取引および商品先渡取引等の証拠金の割合はおおよそ10-30パーセントの範囲で行ないます。(また、最大でも、純資産の50%以下とします。)</p> <p>⑤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、上記のような運用が行なわれない場合があります。</p> <p>⑥当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
関係法人	<p>管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービスズ・リミテッド(ケイマン)</p> <p>受託会社：G.A.S.(ケイマン)リミテッド</p> <p>運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド</p> <p>資産保管会社：SMT Trustees (Ireland) Limited</p> <p>管理事務代行会社：SMT Fund Services (Ireland) Limited</p> <p>管理会社代行サービス会社：大和アセットマネジメント株式会社</p>
報酬等	<p>信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額</p> <p>管理報酬等：0.415% (管理会社代行サービス報酬を含みます。)</p> <p>受託報酬等：0.175% (管理事務代行報酬および資産保管会社の報酬を含みます。)</p> <p>運用報酬等：0.41%</p> <p>合計：1.00%</p> <p>その他、外国投資信託に関する租税、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。</p>
設定日	2006年11月13日
決算日	毎年4月30日

## 【収益分配金に関する留意事項】

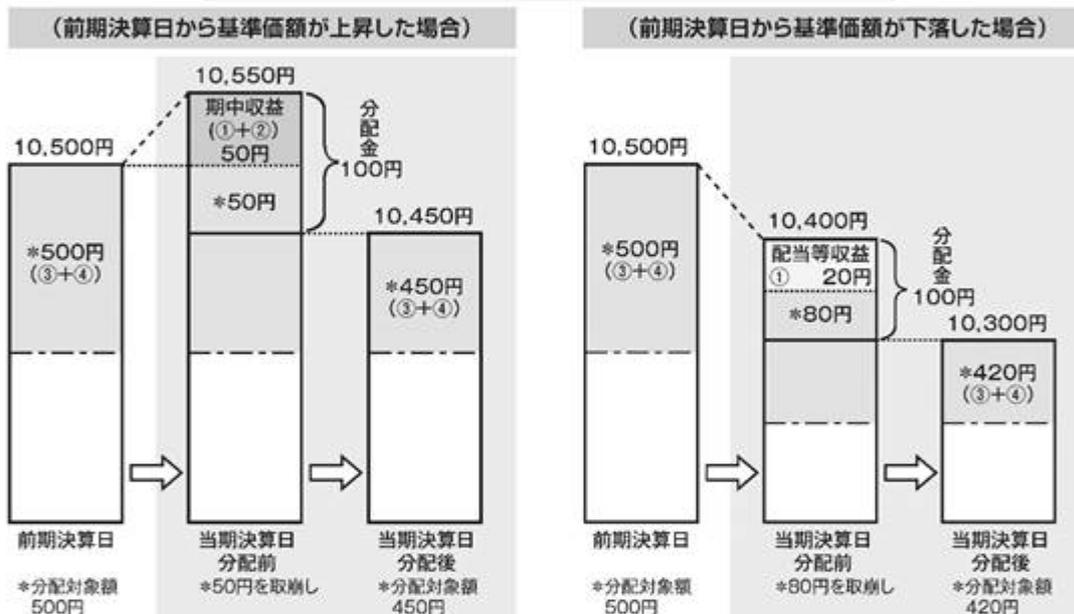
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 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）



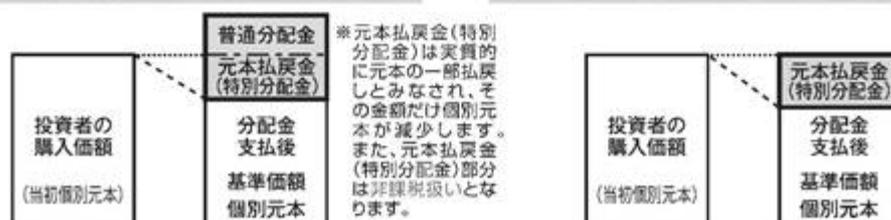
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 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(特別分配金)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】

2006年11月10日

信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
収益分配金（注1）、償還金など お申込金（ 5）		
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 5）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 5）	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	<p>投資対象ファンドの受益証券 など</p> <p>（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における外貨建資産の運用にあたっては、それぞれコーヘン&amp;ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インク、アムンディ・アイルランド・リミテッド（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。）</p>	

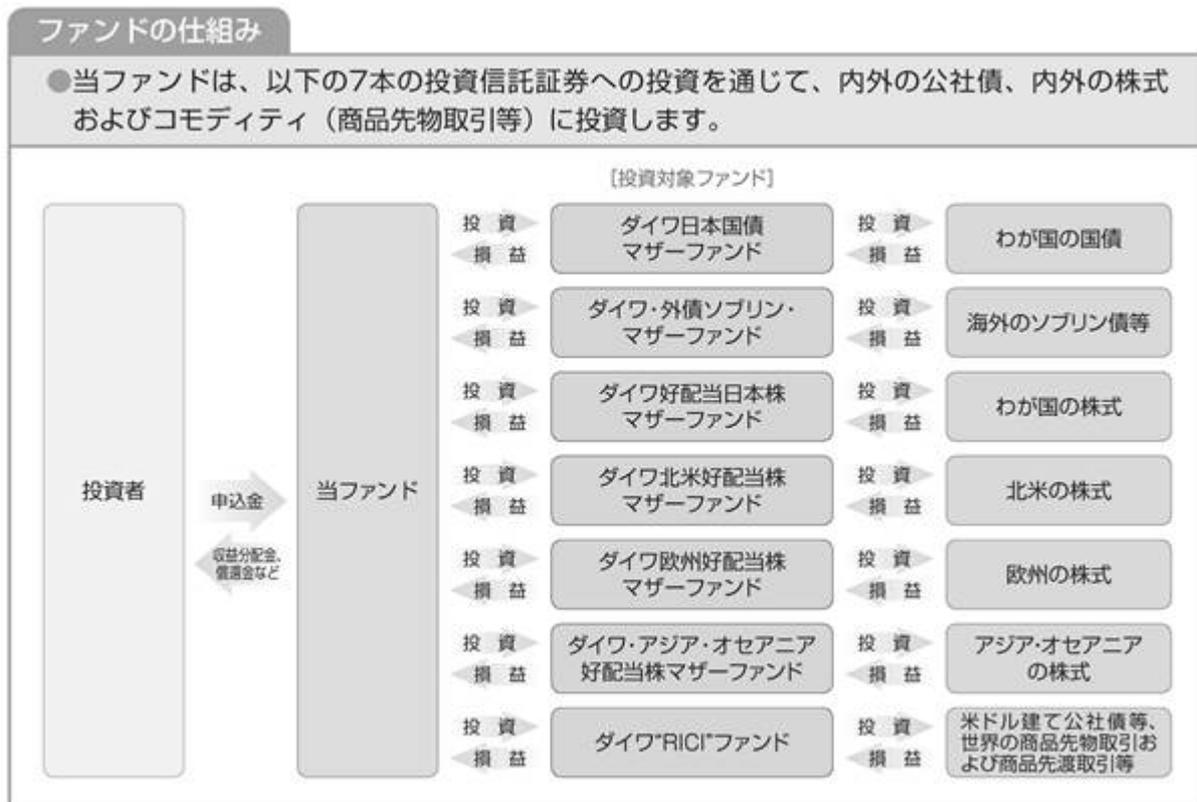
（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

（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せん（ 4）。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

- 3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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



#### < 委託会社の概況（2021年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。<br>(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号) |
| 2020年 4月 1日 | 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更  |

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 主要投資対象

下記の各ファンド（1.から6.までに掲げるファンドを、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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券
4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
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
7. ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」（以下「ダイワ“RICI”ファンド」といいます。）の受益証券（米ドル建）

## 投資態度

イ. 主として複数の投資信託証券を通じて、内外の公社債、内外の株式およびコモディティ（商品先物取引等）に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないません。

ロ. 各投資信託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せん。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5%

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20%

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6.6%

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6.6%

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6.6%

ダイワ“RICI”ファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の20%

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

ニ. 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。また、追加設定または解約の影響により一時的に、標準組入比率から乖離することやファンドの純資産総額以上に投資信託証券の組入比率が高まることがあります。

## &lt; 投資先ファンドについて &gt;

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	ダイワ“ RICI ” ファンド
選定の方針	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数（“ RICI ”）に連動する投資成果をめざすファンドであること。

くわしくは「 1 ファンドの性格(1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色> 」をご参照下さい。

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、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次の1. から6. までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の7. に掲げる外国投資信託の受益証券、ならびに次の8. から11. までに掲げる有価証券（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. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

3. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

4. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券

5. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券

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

7. ダイワ“ RICI ” ファンドの受益証券

8. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## &lt; 投資先ファンドについて &gt;

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は、次のとおりです。

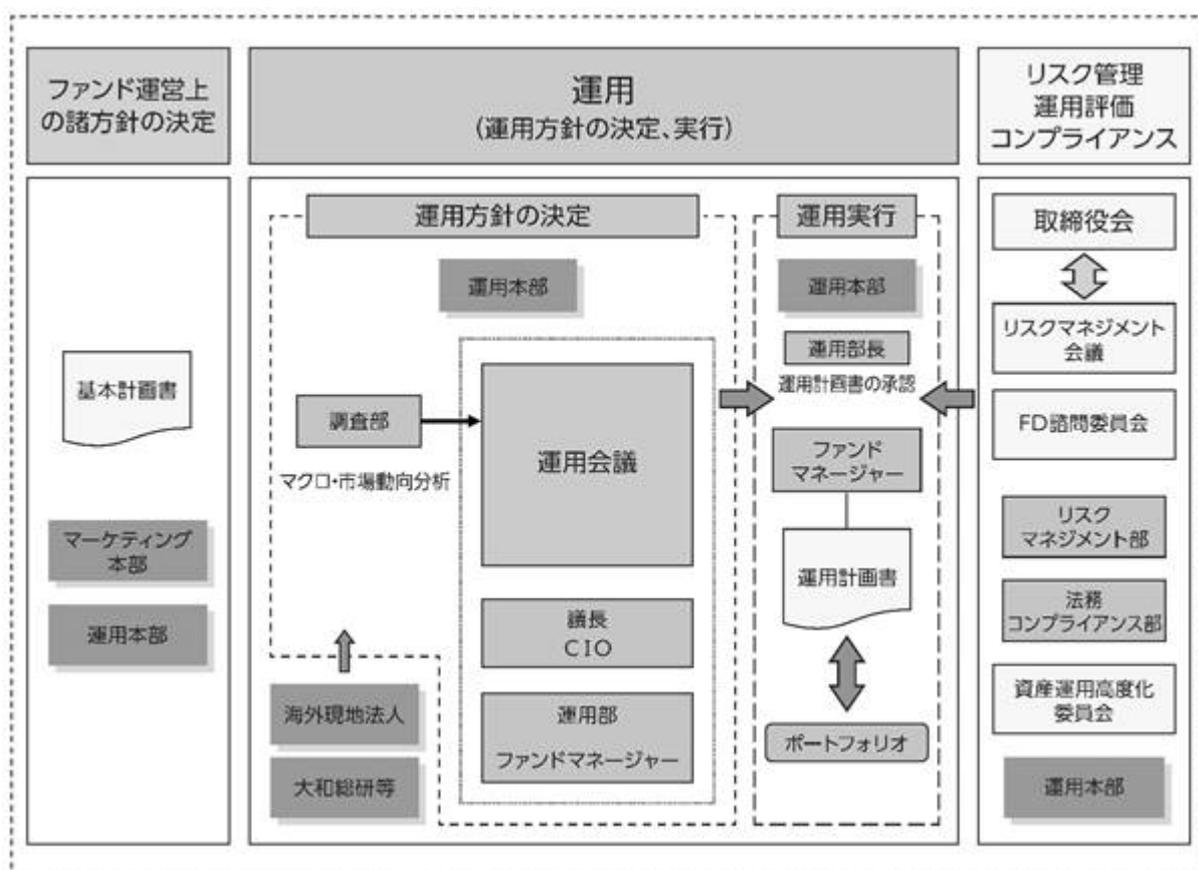
投資先ファンドの名称	ダイワ“ RICI ”ファンド
運用の基本方針	投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数（“ RICI ”）に連動することをめざします。
主要な投資対象	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資します。
委託会社の名称	管理会社：ダイワ・アセット・マネジメント・サービスズ・リミテッド（ケイマン） 運用会社：ダイワ・アセット・マネジメント（シンガポール）リミテッド

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」をご参照下さい。

## (3) 【運用体制】

## 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．CIO（Chief Investment Officer）（3名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

#### ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

#### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

#### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

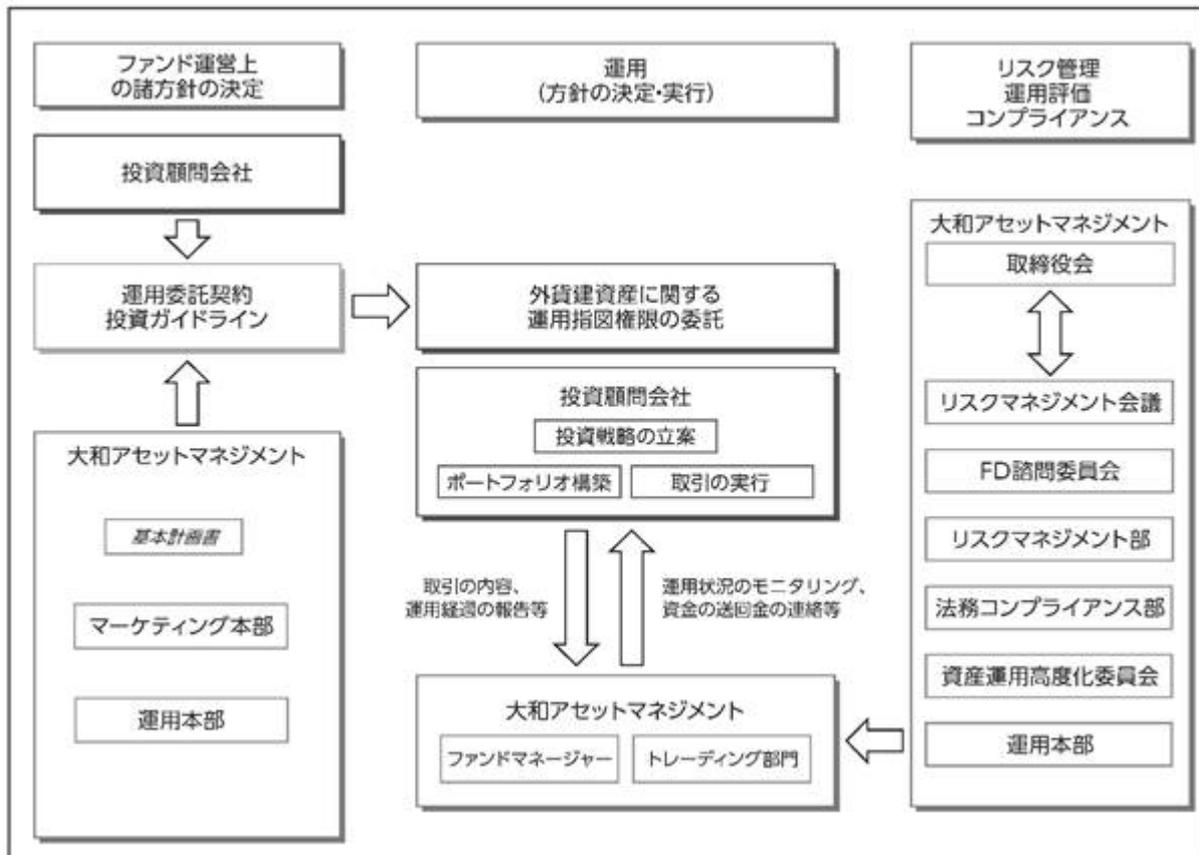
#### ハ．資産運用高度化委員会

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。

#### 受託会社に対する管理体制

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

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



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

#### ロ．運用の実行

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

#### ハ．モニタリング

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

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

#### ニ．リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会（前 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】

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的な分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。なお、5月と11月の計算期末については、収益分配前の基準価額（1万口当たり。以下「収益分配方針」において同じ。）が10,000円を超えている場合、付加分配額を上記継続分配相当額に加えて、以下の金額の範囲内で分配する場合があります。なお、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

- ・収益分配前の基準価額が12,000円未満の場合...500円を上限とします。
- ・収益分配前の基準価額が12,000円以上の場合...1,000円を上限とします。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資制限（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．にかかわらず、委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券で、その約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められているものの時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超える投資の指図をすることができるものとします。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### <参考> 投資対象ファンドについて

下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

#### 1. ダイワ日本国債マザーファンド

主な投資制限	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せん。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

#### 2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

主な投資制限	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せん。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
--------	---

収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

### 3. ダイワ好配当日本株マザーファンド

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	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。

### 4. ダイワ北米好配当株マザーファンド

### 5. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

### 6. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
運用指図 権限の委託	<p>&lt;ダイワ北米好配当株マザーファンド&gt; 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&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク New York, New York, USA 前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。</p> <p>&lt;ダイワ欧州好配当株マザーファンド&gt; 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。 アムンディ・アイルランド・リミテッド 1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド (ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)</p> <p>&lt;ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド&gt; 該当事項はありません。</p>
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。

償還条項	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。
------	---

## 7. ダイワ“RICI”ファンド

「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として内外の株式、内外の公社債およびコモディティ（商品先物取引等）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### 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。

#### 商品先物取引等による運用に伴うリスク

商品先物等の取引価格は、様々な要因（商品の需給関係の変化、天候、農業生産、貿易動向、為替レート、金利の変動、政治的・経済的事由および政策、疾病、伝染病、技術発展等）に基づき変動します（個々の品目により具体的な変動要因は異なります。）。

当ファンドでは、投資するファンドを通じて商品先物取引等による運用を行ないますので、基準価額は、商品先物ポートフォリオの構成品の値動きの影響を受けます。

当ファンドの基準価額は、商品先物市場の変動の影響を受け、投資元本を下回ることがあります。

その他、基準価額に影響を与える要因として、次のものが考えられます。

- ・商品先物は、米ドル、カナダ・ドル、豪ドルなど各国の通貨建てで取引されるため、為替変動による影響を受けます。

- ・商品市場は、市場の流動性の不足、投機家の参入および政府の規制・介入等の様々な要因により、一時的に偏向するかその他の混乱を生じることがあります。
- ・各々の商品先物の上場市場が定める値幅制限（1営業日に発生する先物契約の変動額を制限する規則）などの規制・規則によって、不利な価格での契約の清算を迫られる可能性があります。
- ・当ファンドによる建玉が市場の一定割合を超えた場合に、取引所による建玉規制が行なわれ、指数の構成どおりに組入れができなくなる可能性があります。
- ・値段の低い期近の先物を値段の高い期先の先物に買換える場合、マイナスの影響を及ぼす可能性があります。

外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

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

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

#### ロ．カンントリー・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可能性があります。

その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

基準価額適用日および解約代金の受渡日について原則として下記のようになります。

- ・当ファンドの追加設定または解約申込みに対する基準価額の適用日は申込日の翌々営業日です。

- ・解約申込時の解約代金の受渡日は申込日から起算して6営業日目以降です。
- ・当ファンドの基準価額は、組入れている投資信託証券の基準価額をもって毎営業日計算されます。
- ・当ファンドの基準価額に用いる投資信託証券の基準価額は、国内資産のマザーファンドについては当日の国内マーケットが反映された当日の基準価額、外国資産のマザーファンドについては前営業日の海外マーケットが反映された当日の基準価額です。また「ダイワ“RICI”ファンド」に関しては、前々営業日の海外マーケットが反映された前営業日の基準価額です。ただし、「ダイワ“RICI”ファンド」のファンド営業日は東京証券取引所およびロンドン、ニューヨークの銀行のいずれもが営業日の日であり、いずれかの市場が休業日の場合、基準価額は算出されません。そのため、前営業日が休業日の場合、その直近のファンド営業日の基準価額を用いることとなります。



### (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。

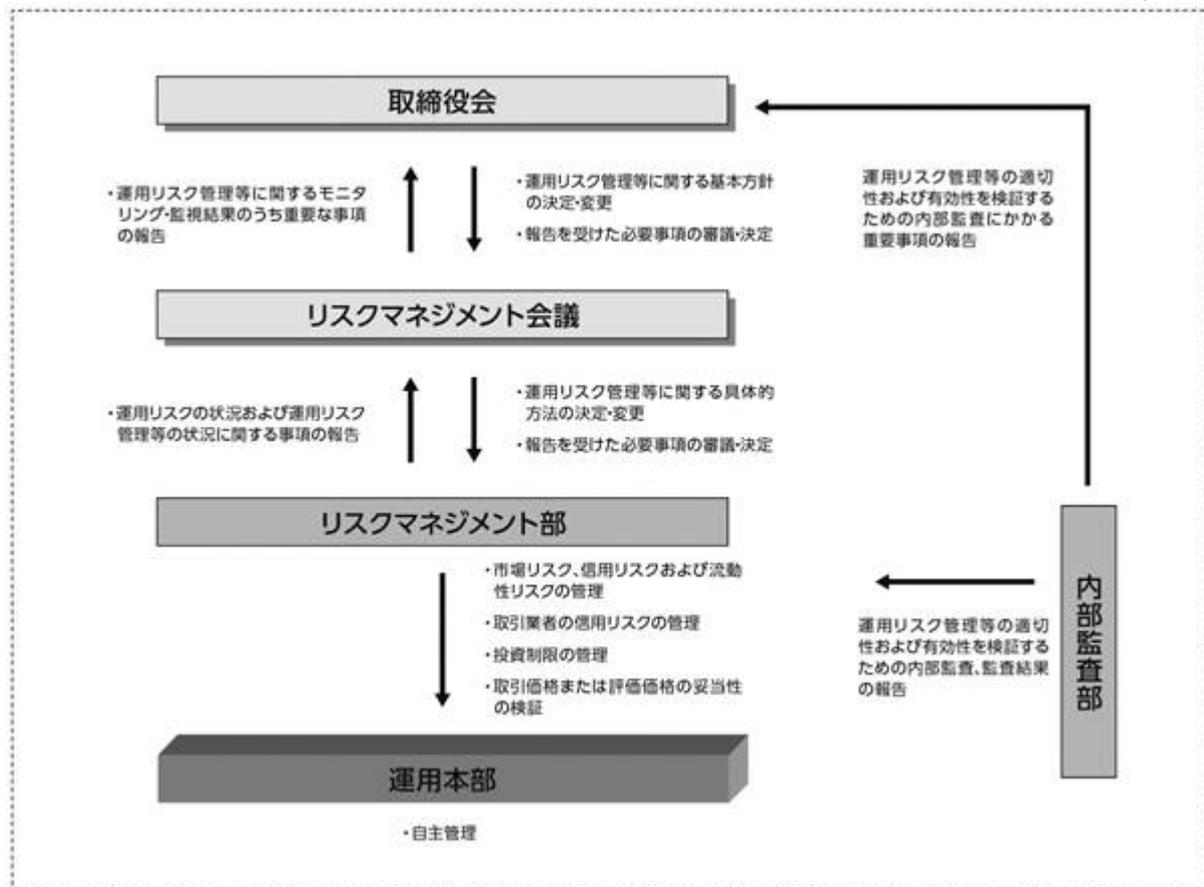
#### 流動性リスクに関する事項

- ・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ある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、換金の申込みの受け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・検証などを行いません。
- ・ 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。

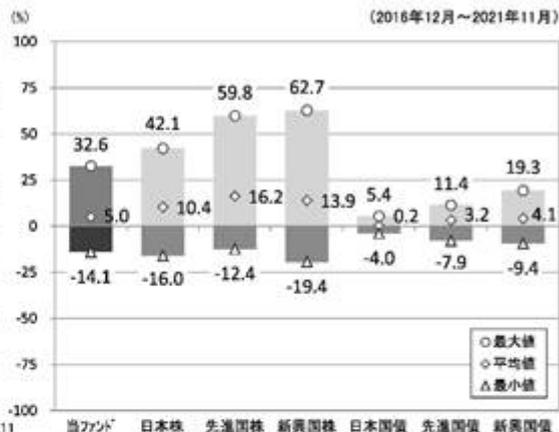
## 参考情報

- 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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.485%（税抜1.35%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.65% （税抜）	年率0.65% （税抜）	年率0.05% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

委託会社は、「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」の各投資顧問会社が受ける報酬を支払うものとし、その額は当該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。

投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率1.685%（税込）程度です（当ファンドにおける実際の投資信託証券の組入状況により変動します。）。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4)【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（台湾株式等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる

監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

#### <投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各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。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20% (所得税15%および地方税5%) の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)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。

### 法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

### <注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2021年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】

## (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(%)
投資信託受益証券	177,048,582	20.21
内 ケイマン諸島	177,048,582	20.21
親投資信託受益証券	694,683,707	79.29
内 日本	694,683,707	79.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,430,731	0.51
純資産総額	876,163,020	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）

## 【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	165,503,250	1.9036 315,051,986	1.8731 310,004,137	35.38
2	DAIWA RICIFUND	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	20,296.29	9,107.74 184,853,367	8,723.20 177,048,582	20.21
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	50,917,973	3.4478 175,560,079	3.3200 169,047,670	19.29
4	ダイワ北米好配当株マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	13,343,940	4.3794 58,438,455	4.3821 58,474,479	6.67
5	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	20,650,544	2.8445 58,742,537	2.7809 57,427,097	6.55

6	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	27,785,205	2.1351 59,326,969	2.0321 56,462,315	6.44
7	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	34,249,988	1.2631 43,261,159	1.2633 43,268,009	4.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	20.21%
親投資信託受益証券	79.29%
合計	99.49%

(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。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11特定期間末 (2012年5月10日)	2,942,283,607	2,958,746,313	0.6255	0.6290
第12特定期間末 (2012年11月12日)	2,755,197,492	2,770,826,230	0.6170	0.6205
第13特定期間末 (2013年5月10日)	3,372,265,613	3,386,433,677	0.8331	0.8366
第14特定期間末 (2013年11月11日)	2,826,036,326	2,838,532,137	0.7916	0.7951

第15特定期間末 (2014年5月12日)	2,615,870,672	2,626,894,130	0.8306	0.8341
第16特定期間末 (2014年11月10日)	2,438,285,558	2,445,128,906	0.8908	0.8933
第17特定期間末 (2015年5月11日)	2,106,332,670	2,112,162,760	0.9032	0.9057
第18特定期間末 (2015年11月10日)	1,853,001,272	1,856,294,425	0.8440	0.8455
第19特定期間末 (2016年5月10日)	1,618,028,115	1,621,254,105	0.7523	0.7538
第20特定期間末 (2016年11月10日)	1,561,397,528	1,563,530,863	0.7319	0.7329
第21特定期間末 (2017年5月10日)	1,576,785,224	1,578,754,950	0.8005	0.8015
第22特定期間末 (2017年11月10日)	1,515,682,218	1,517,446,577	0.8591	0.8601
第23特定期間末 (2018年5月10日)	1,392,998,583	1,394,652,872	0.8421	0.8431
第24特定期間末 (2018年11月12日)	1,258,210,178	1,259,756,691	0.8136	0.8146
第25特定期間末 (2019年5月10日)	1,160,207,954	1,161,695,550	0.7799	0.7809
第26特定期間末 (2019年11月11日)	1,141,101,845	1,142,522,000	0.8035	0.8045
第27特定期間末 (2020年5月11日)	917,677,333	918,998,336	0.6947	0.6957
第28特定期間末 (2020年11月10日)	990,117,394	991,395,428	0.7747	0.7757
2020年11月末日	988,987,962	-	0.7926	-
12月末日	998,481,073	-	0.8125	-
2021年1月末日	992,987,809	-	0.8297	-
2月末日	997,673,377	-	0.8636	-
3月末日	979,114,481	-	0.8905	-
4月末日	975,945,885	-	0.9034	-
第29特定期間末 (2021年5月10日)	990,251,297	991,330,396	0.9177	0.9187
5月末日	964,090,476	-	0.9196	-
6月末日	955,269,201	-	0.9237	-
7月末日	938,364,624	-	0.9223	-

8月末日	924,067,306	-	0.9239	-
9月末日	904,656,765	-	0.9361	-
10月末日	921,748,673	-	0.9645	-
第30特定期間末 (2021年11月10日)	908,354,327	909,302,662	0.9578	0.9588
11月末日	876,163,020	-	0.9336	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11特定期間	0.0105
第12特定期間	0.0105
第13特定期間	0.0105
第14特定期間	0.0105
第15特定期間	0.0105
第16特定期間	0.0095
第17特定期間	0.0075
第18特定期間	0.0065
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0040
第21特定期間	0.0030
第22特定期間	0.0030
第23特定期間	0.0030
第24特定期間	0.0030
第25特定期間	0.0030
第26特定期間	0.0030
第27特定期間	0.0030
第28特定期間	0.0030
第29特定期間	0.0030
第30特定期間	0.0030

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第11特定期間	4.7
第12特定期間	0.3
第13特定期間	36.7
第14特定期間	3.7
第15特定期間	6.3
第16特定期間	8.4
第17特定期間	2.2

第18特定期間	5.8
第19特定期間	10.3
第20特定期間	2.2
第21特定期間	9.8
第22特定期間	7.7
第23特定期間	1.6
第24特定期間	3.0
第25特定期間	3.8
第26特定期間	3.4
第27特定期間	13.2
第28特定期間	11.9
第29特定期間	18.8
第30特定期間	4.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第11特定期間	103,970,374	624,452,296
第12特定期間	84,393,551	322,670,026
第13特定期間	80,023,659	497,359,212
第14特定期間	60,242,422	538,029,012
第15特定期間	48,791,311	469,463,422
第16特定期間	42,853,299	455,073,722
第17特定期間	33,393,329	438,696,400
第18特定期間	29,536,461	166,137,284
第19特定期間	35,191,350	79,966,689
第20特定期間	31,240,696	48,565,438
第21特定期間	25,904,022	189,512,877
第22特定期間	23,628,613	228,995,410
第23特定期間	22,527,421	132,597,227
第24特定期間	23,044,261	130,820,279
第25特定期間	25,409,697	84,327,166
第26特定期間	28,046,001	95,487,123
第27特定期間	19,781,667	118,933,847
第28特定期間	19,227,544	62,196,116
第29特定期間	15,238,084	214,172,872
第30特定期間	13,013,355	143,777,130

## (参考) マザーファンド

## 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)

## 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ・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)

## 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	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)

#### 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	ガラス・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	デクセリアルズ	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	T D K	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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ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）

## 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。

## □．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。

## 八．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。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年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)

### 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

### (1) 投資状況 (2021年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)

#### 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

## ●ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド

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	9,336円
純資産総額	8.7億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.1%
3カ月間	1.3%
6カ月間	1.8%
1年間	18.6%
3年間	18.8%
5年間	25.3%
設定来	37.5%

※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： 60円 設定来分配金合計額： 3,075円

決算期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
	20年1月	20年3月	20年5月	20年7月	20年9月	20年11月	21年1月	21年3月	21年5月	21年7月	21年9月	21年11月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10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(除く債券)	国・地域名	比率
外国債券	34	34.7%	米ドル	35.5%	直接利回り(%)	DAIWA RICIFUND	ケイマン諸島	20.2%
外国投資信託	1	20.2%	日本円	25.0%	最終利回り(%)	日立	日本	0.8%
国内株式	109	18.3%	ユーロ	12.2%	修正デュレーション	トヨタ自動車	日本	0.6%
外国株式	156	17.8%	豪ドル	6.3%	残存年数	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.6%
国内債券	34	4.9%	英ポンド	5.7%	債券格付別構成	AGC	日本	0.5%
外貨先立投資証券等	61	1.1%	カナダ・ドル	4.9%	AAA	オリックス	日本	0.5%
			ポーランド・ズロチ	2.0%	AA	東京エレクトロン	日本	0.5%
			台湾ドル	1.9%	A	富士フイルムHLDGS	日本	0.5%
			韓国ウォン	1.6%	BBB	東京海上HD	日本	0.5%
コール・ローン、その他	2.9%		その他	4.9%	BB	デクセリアルズ	日本	0.5%
合計	395	100.0%	合計	100.0%	合計	合計		25.2%

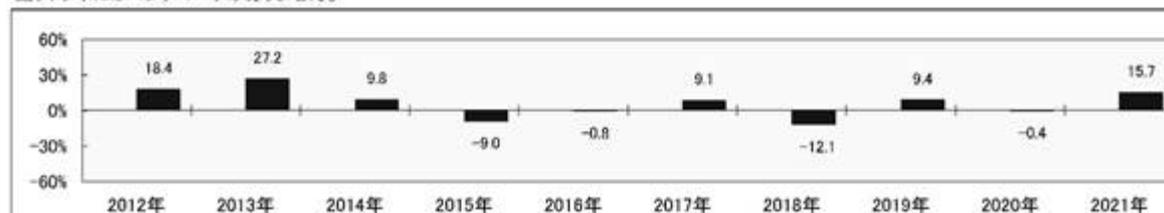
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

## 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、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申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌々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いません。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いません。

### 2【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに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け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌々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6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)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) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ダイワ“RICI”ファンドの受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・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。

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電

信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年1月11日から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、2006年11月10日から2007年1月10日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、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、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

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

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を毎年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。

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### < 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

#### < 換金請求権 >

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



### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

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

ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド

## (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
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	10,016	10,393
コール・ローン	11,317,175	9,151,053
投資信託受益証券	206,269,372	183,374,800
親投資信託受益証券	777,537,460	719,292,019
流動資産合計	995,134,023	911,828,265
資産合計	995,134,023	911,828,265
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,079,099	948,335
未払解約金	1,318,259	215,690
未払受託者報酬	90,535	84,102
未払委託者報酬	2,354,240	2,186,923
その他未払費用	40,593	38,888
流動負債合計	4,882,726	3,473,938
負債合計	4,882,726	3,473,938
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,079,099,657	1 948,335,882
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 88,848,360	2 39,981,555
（分配準備積立金）	38,574,885	71,414,721
元本等合計	990,251,297	908,354,327
純資産合計	990,251,297	908,354,327
負債純資産合計	995,134,023	911,828,265

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 2020年11月11日 至 2021年5月10日		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		172,866,089		42,654,595
為替差損益		6,363,910		7,178,613
その他収益		4,150		-
営業収益合計		179,234,150		49,833,208
営業費用				
支払利息		826		1,026
受託者報酬		271,119		259,845
委託者報酬		<sup>1</sup> 7,050,258		<sup>1</sup> 6,756,996
その他費用		<sup>2</sup> 336,258		<sup>2</sup> 380,782
営業費用合計		7,658,461		7,398,649
営業利益		171,575,689		42,434,559
経常利益		171,575,689		42,434,559
当期純利益		171,575,689		42,434,559
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		2,640,241		696,943
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		287,917,051		88,848,360
剰余金増加額又は欠損金減少額		35,977,450		11,009,078
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		35,977,450		11,009,078
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,394,457		915,380
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,394,457		915,380
分配金		<sup>3</sup> 3,449,750		<sup>3</sup> 2,964,509
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		88,848,360		39,981,555

## (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
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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	前 期	当 期
	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1. 1 期首元本額	1,278,034,445円	1,079,099,657円
期中追加設定元本額	15,238,084円	13,013,355円
期中一部解約元本額	214,172,872円	143,777,130円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,079,099,657口	948,335,882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88,848,360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39,981,555円であります。

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前 期	当 期
	自 2020年11月11日 至 2021年5月10日	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	326,479円	311,258円
2. 2 その他費用	主に、海外カストディアンに対するカストディフィーであります。	主に、海外カストディアンに対するカストディフィーであります。

## 3. 3 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(2,073,437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(2,324,064円)及び分配準備積立金(24,339,423円)より分配対象額は28,736,924円(1万口当たり235.64円)であり、うち1,219,524円(1万口当たり10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(2,400,896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(2,298,657円)及び分配準備積立金(23,678,528円)より分配対象額は28,378,081円(1万口当たり246.52円)であり、うち1,151,127円(1万口当たり10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(1,581,035円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,799,149円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,308,872円)及び分配準備積立金(36,562,613円)より分配対象額は43,251,669円(1万口当たり421.05円)であり、うち1,027,243円(1万口当たり10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(1,833,991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(11,105,030円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,386,456円)及び分配準備積立金(38,265,683円)より分配対象額は53,591,160円(1万口当たり541.91円)であり、うち988,931円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

	<p>（自2021年3月11日 至2021年5月10日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,340,961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（12,040,908円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,256,001円）及び分配準備積立金（23,272,115円）より分配対象額は41,909,985円（1万口当たり388.38円）であり、うち1,079,099円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2021年9月11日 至2021年11月10日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,158,450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（21,259,961円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,502,481円）及び分配準備積立金（47,944,645円）より分配対象額は74,865,537円（1万口当たり789.44円）であり、うち948,335円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
--	---	--

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 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	<p>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。なお、当ファンドは、投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引（商品先物取引）に投資しており、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 2021年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）
投資信託受益証券	15,565,782	16,094,028
親投資信託受益証券	29,472,941	4,595,639
合計	45,038,723	20,689,667

## （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)	0.9177円 (9,177円)	0.9578円 (9,578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	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	アメリカ・ドル	DAIWA RICI FUND	20,296.286	アメリカ・ドル 1,624,798.870	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 1,624,798.870 (183,374,800)	
投資信託受益証券 合計				183,374,800 [183,374,800]	
親投資信託 受益証券	日本円	ダイワ・外債ソブリン・マザー ファンド	165,503,250	日本円 315,051,986	
		ダイワ日本国債マザーファンド	34,249,988	43,261,159	
		ダイワ好配当日本株マザーファ ンド	51,204,498	176,547,988	
		ダイワ北米好配当株マザーファ ンド	14,469,451	63,367,513	
		ダイワ欧州好配当株マザーファ ンド	28,728,735	61,341,594	
		ダイワ・アジア・オセアニア好 配当株マザーファンド	20,994,790	59,721,779	
	日本円	小計		日本円 719,292,019	
親投資信託受益証券 合計				719,292,019	

合計		902,666,819 [183,374,800]
----	--	------------------------------

投資信託受益証券及び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。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄	100%	100%

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、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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」受益証券及び「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。

また、当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「Daiwa “RICI” Fund」受益証券（米ドル建）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「投資信託受益証券」は、すべて同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及び同ファンドの状況は次のとおりであります。

「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	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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

## （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V A （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）

## 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。

## 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）
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	1.2603円	1.2631円
(1万口当たり純資産額)	(12,603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・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

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年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)

## 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。

## 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	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）
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

種 類	2021年5月10日 現在				2021年11月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	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。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。  
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額	1.8940円	1.9036円
(1万口当たり純資産額)	(18,940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	13,998,800.000	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		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,320,000.000	4,519,670.400	
	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		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,957,000.000	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	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	スウェーデン・クローナ 13,630,000.000	スウェーデン・クローナ 14,098,872.000	
	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	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,500,000.000	デンマーク・クローネ 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	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	ノルウェー・クローネ 20,000,000.000	ノルウェー・クローネ 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		ユーロ	ユーロ	

		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	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	100%	13.7%
	特殊債券	2銘柄		
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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年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)

## 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。
--------------------------------	---

## 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	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	3.3079円	3.4479円
（1万口当たり純資産額）	（33,079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グ	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ションズ	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
ソディック	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
フリーー	45,400	1,592.00	72,276,800
サト-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
TDK	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。

「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	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年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)

## 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。

## 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	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		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	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。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。  
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額	3.9054円	4.3794円
(1万口当たり純資産額)	(39,054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	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	81.9%	17.5%	0.6%	
	ハイブリッド	56銘柄				
	優先証券	4銘柄				
	投資証券					
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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年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）

## 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。

## 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	2.0103円	2.1352円
(1万口当たり純資産額)	(20,103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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年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）

## 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。

## 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	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	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	
	WEICHAJ 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。

## 「Daiwa “ RICI ” Fund」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

財政状態計算書  
2020年4月30日現在

米ドル

<b>資産</b>	
現金	157,233,249
受取勘定	666
金融資産(損益通算後の評価額)	209,709,869
<b>資産合計</b>	<b>366,943,784</b>
<b>資本</b>	
受益証券元本	623,664,489
利益剰余金	(275,141,142)
<b>資本合計</b>	<b>348,523,347</b>
<b>負債</b>	
当座借越	3,285,659
支払勘定	345,862
金融負債(損益通算後の評価額)	14,788,916
<b>負債合計</b>	<b>18,420,437</b>
<b>資本および負債合計</b>	<b>366,943,784</b>

包括利益計算書  
2020年4月30日に終了した年度

米ドル

<b>営業収益</b>	
銀行利息収入	1,607,234
金融資産および負債(損益通算後の評価額)による損益	(178,209,200)
投資損益合計	(176,601,966)
<b>営業費用</b>	
運用会社報酬	3,988,121
管理会社報酬	725,113
受託会社報酬	48,341
保管会社報酬	72,511
仲介手数料	956,285
監査報酬	24,318
その他費用	9,914
営業費用合計	5,824,603
<b>当会計年度の営業損失</b>	<b>(182,426,569)</b>
<b>金融費用</b>	
支払銀行利息	(28,898)
金融費用合計	(28,898)
<b>包括損失合計</b>	<b>(182,455,467)</b>

組入資産の明細  
2020年4月30日現在

債券	元本	評価額 米ドル	純資産に 占める比率 (%)
----	----	------------	----------------------

**米国**

US T-Bill 0% YLD 21-May-2020	20,000,000	19,980,677	5.73
US T-Bill 0% YLD 18-Jun-2020	23,000,000	22,951,987	6.59
US T-Bill 0% YLD 16-Jul-2020	40,000,000	39,869,955	11.44
US T-Bill 0% YLD 13-Aug-2020*	25,000,000	24,893,472	7.14
US T-Bill 0% YLD 10-Sep-2020	51,000,000	50,722,773	14.55
US T-Bill 0% YLD 05-Nov-2020	40,000,000	39,726,878	11.4

**債券合計****198,145,742****56.85**

先物取引	数量	取引金額 米ドル	評価益 米ドル	評価(損) 米ドル
<b>フランス</b>				
Milling Wheat (EOP) - Sep-2020	689	7,061,797	-	(100,028)
Rapeseed (EOP) - Aug-2020	177	3,534,014	28,319	-
		10,595,811	28,319	(100,028)
<b>日本</b>				
Rubber (TCM) - Oct-2020	518	3,647,744	-	(164)
		3,647,744	-	(164)
<b>英国</b>				
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2020	523	15,427,890	-	(1,578,850)
Brent Crude Oil (ICE) - Aug-2020	1,166	31,860,910	1,148,550	-
Coffee Robusta (ICE) - Jul-2020	582	7,101,780	-	(152,700)
Copper Grade A (LME) - May-2020	138	19,456,131	-	(1,618,769)
Copper Grade A (LME) - May-2020	(138)	(16,914,819)	-	(922,544)
Copper Grade A (LME) - Jun-2020	127	15,416,338	1,026,987	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2020	(85)	(11,083,581)	78,206	-
Copper Grade A (LME) - Jul-2020	69	9,009,719	-	(63,438)
Gas Oil (ICE) - Jun-2020	48	1,399,800	-	(177,000)
Gas Oil (ICE) - Jul-2020	114	2,959,200	113,100	-
No. 7 Cocoa (ICE) - Jul-2020	152	3,372,667	312,298	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2020	461	19,562,906	-	(2,658,612)
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2020	(461)	(17,562,838)	658,544	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2020	395	14,927,894	-	(303,019)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2020	(266)	(9,889,688)	41,038	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2020	241	9,012,344	-	(36,600)
Primary Nickel (LME) - May-2020	65	4,842,966	-	(109,146)
Primary Nickel (LME) - May-2020	(65)	(4,467,024)	-	(266,796)
Primary Nickel (LME) - Jun-2020	56	3,822,441	263,319	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2020	(38)	(2,786,730)	14,250	-
Primary Nickel (LME) - Jul-2020	31	2,277,288	-	(11,250)
Special High Grade Zinc (LME) - May-2020	191	9,627,594	-	(388,017)
Special High Grade Zinc (LME) - May-2020	(191)	(9,023,781)	-	(215,796)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2020	162	7,628,537	215,300	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2020	(109)	(5,287,269)	9,625	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2020	94	4,563,406	-	(7,931)
Standard Lead (LME) - May-2020	215	9,852,631	-	(1,154,537)
Standard Lead (LME) - May-2020	(215)	(9,304,931)	606,838	-
Standard Lead (LME) - Jun-2020	179	7,703,100	-	(421,156)
Standard Lead (LME) - Jun-2020	(121)	(4,946,831)	24,400	-
Standard Lead (LME) - Jul-2020	110	4,513,500	-	(22,750)
Tin (LME) - May-2020	59	4,832,015	-	(329,135)
Tin (LME) - May-2020	(59)	(4,346,330)	-	(156,550)
Tin (LME) - Jun-2020	53	3,852,005	190,305	-
Tin (LME) - Jun-2020	(36)	(2,753,910)	8,190	-
Tin (LME) - Jul-2020	29	2,213,605	-	(7,575)
White Sugar (ICE) - Aug-2020	218	3,595,845	68,735	-
		120,464,780	4,779,685	(10,602,171)
<b>米国</b>				
Corn (CBT) - Jul-2020	1,023	17,557,537	-	(1,189,537)

Cotton No. 2 (NYB) - Jul-2020	544	13,674,655	1,919,105	-
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2020	121	2,159,835	-	(140,648)
Gasoline Rbob (NYM) - Jun-2020	134	3,644,554	766,110	-
Gasoline Rbob (NYM) - Jul-2020	220	7,317,677	147,319	-
Gold (CMX) - Jun-2020	38	6,239,420	198,540	-
Gold (CMX) - Aug-2020	65	11,116,560	-	(60,060)
Hard Red Spring Wheat (MGE) - Jul-2020	133	3,607,500	-	(179,425)
Heating Oil (NYM) - Jun-2020	49	1,985,185	-	(270,665)
Heating Oil (NYM) - Jul-2020	125	4,503,652	139,973	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2020	420	7,383,060	802,740	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2020	624	13,291,950	248,850	-
KC HRW Wheat - Jul-2020	144	3,541,688	-	(28,088)
Lean Hogs (CME) - Jun-2020	48	1,324,900	-	(193,060)
Lean Hogs (CME) - Aug-2020	89	2,205,080	30,600	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Sep-2020	366	9,414,450	236,970	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Oct-2020	1,338	35,824,440	1,198,020	-
Live Cattle (CME) - Jun-2020	70	2,744,800	-	(338,200)
Live Cattle (CME) - Aug-2020	125	4,571,610	33,390	-
Lumber (CME) - Jul-2020	89	2,969,208	179,256	-
Milk Future (CME) - May-2020	9	229,420	-	(24,760)
Milk Future (CME) - Jun-2020	19	476,740	-	(4,020)
Oat (CBT) - Jul-2020	127	1,684,700	118,700	-
Palladium (NYM) - Jun-2020	2	446,000	-	(54,800)
Palladium (NYM) - Sep-2020	4	775,300	5,420	-
Platinum (NYM) - Jul-2020	162	6,945,435	-	(360,135)
Rough Rice (CBT) - Jul-2020	91	2,559,750	132,030	-
Silver (CMX) - Jul-2020	186	13,325,790	599,100	-
Soybean Meal (CBT) - Jul-2020	88	2,776,750	-	(179,870)
Soybean Oil (CBT) - Jul-2020	444	7,204,380	-	(118,140)
Soybeans (CBT) - Jul-2020	288	12,666,137	-	(350,537)
Sugar No. 11 World (NYB) - Jul-2020	312	3,649,464	-	(25,771)
Wheat (CBT) - Jul-2020	359	9,979,125	-	(568,837)
		217,796,752	6,756,123	(4,086,553)
<b>先物取引合計</b>		<b>352,505,087</b>	<b>11,564,127</b>	<b>(14,788,916)</b>

## 投資明細

2021年11月10日現在における「ダイワ・株ノ債券ノコモディティ・バランスファンド」が組入れている Daiwa “ RICI ” Fundの投資有価証券の状況を示しております。

## (1) 有価証券

(単位：USドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US TREASURY BILL 0PCT 07APR22	60,000,000.00	59,990,377.04	
US TREASURY BILL 0PCT 02DEC21	50,000,000.00	49,998,485.03	
US TREASURY BILL 0PCT 24FEB22	50,000,000.00	49,997,517.55	
US TREASURY BILL 0PCT 27JAN22	50,000,000.00	49,996,873.88	
US TREASURY BIL 0PCT 13JAN22	50,000,000.00	49,996,641.72	
US TREASURY BILL 0PCT 03MAR22	50,000,000.00	49,994,854.18	
US TREASURY BILL 21APR22	50,000,000.00	49,993,095.01	
US TREASURY BILL 0PCT 24MAR22	50,000,000.00	49,992,875.32	
US TREASURY BILL 0PCT 19MAY22	50,000,000.00	49,989,389.28	

US TREASURY BILL 0PCT 16JUN22	50,000,000.00	49,984,791.40	
US TREASURY BILL 0PCT 14JUL22	45,000,000.00	44,986,106.25	
US TREASURY BILL 0PCT 11AUG22	40,000,000.00	39,970,361.12	

## (2) 商品先物

(単位：USドル)

銘柄	買建/売建	数量	評価損益	備考
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-22	買建	191	501,570.30	
MILLING WHEAT (EOP) MAR-22	買建	926	-100,708.09	
TIN (LME) JAN-22	売建	1	-4,577.50	
COPPER GRADE A (LME) JAN-22	売建	2	-10,275.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-22	売建	2	-5,976.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-22	売建	4	-2,950.00	
STANDARD LEAD (LME) JAN-22	売建	5	-1,750.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-22	売建	9	-11,306.25	
TIN (LME) NOV-21	買建	41	929,892.50	
TIN (LME) NOV-21	売建	41	-676,492.50	
TIN (LME) DEC-21	買建	41	693,122.50	
TIN (LME) DEC-21	売建	41	-159,357.50	
TIN (LME) JAN-22	買建	43	161,002.50	
PRIMARY NICKEL (LME) NOV-21	買建	61	77,967.00	
PRIMARY NICKEL (LME) NOV-21	売建	61	-591,057.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-21	買建	66	627,000.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-21	売建	66	-29,916.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-22	買建	66	25,278.00	
COPPER GRADE A (LME) NOV-21	買建	119	1,320,962.50	
COPPER GRADE A (LME) NOV-21	売建	119	-2,444,243.75	
COPPER GRADE A (LME) DEC-21	買建	126	2,029,387.50	
COPPER GRADE A (LME) DEC-21	売建	126	-207,750.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-22	買建	128	228,887.50	
GAS OIL (ICE) JAN-22	買建	126	87,150.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-21	買建	186	1,432,493.75	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) NOV-21	売建	186	-1,404,222.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-21	買建	190	1,321,800.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-21	売建	190	523,912.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-22	買建	184	-450,131.25	
STANDARD LEAD (LME) NOV-21	買建	243	707,307.50	
STANDARD LEAD (LME) NOV-21	売建	243	-1,524,625.00	
STANDARD LEAD (LME) DEC-21	買建	269	1,635,031.25	
STANDARD LEAD (LME) DEC-21	売建	269	275,968.75	

STANDARD LEAD (LME) JAN-22	買建	256	-229,400.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-22	買建	296	128,770.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-22	買建	311	-218,653.79	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-21	買建	422	-1,304,805.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) NOV-21	売建	422	3,020,702.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-21	買建	398	-2,727,550.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-21	売建	398	1,316,531.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-22	買建	456	-1,446,900.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) JAN-22	買建	684	220,290.00	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-22	買建	1,179	-570,010.00	
RUBBER (OSE) APR-22	買建	733	-395,136.72	
PALLADIUM (NYM) MAR-22	買建	11	76,500.00	
MILK FUTURE (CME) DEC-21	買建	40	-69,460.00	
LUMBER (CME) JAN-22	買建	88	-6,215.00	
OAT (CBT) MAR-22	買建	110	15,300.00	
HEATING OIL (NYM) JAN-22	買建	129	-106,449.00	
HARD RED SPRING WHEAT (MGE) MAR-22	買建	149	-297,387.50	
SOYBEAN MEAL (CBT) JAN-22	買建	171	-10,550.00	
KC HRW WHEAT FUT (CBT) MAR-22	買建	191	-120,225.00	
GOLD (CMX) FEB-22	買建	208	712,160.00	
ROUGH RICE (CBT) JAN-22	買建	208	-135,520.00	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) JAN-22	買建	229	-448,963.20	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) JAN-22	買建	240	-465,247.50	
SILVER (CMX) MAR-22	買建	248	621,745.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-22	買建	253	114,280.00	
PLATINUM (NYM) JAN-22	買建	265	749,010.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-22	買建	274	276,990.00	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-22	買建	340	-208,790.40	
SOYBEAN OIL (CBT) JAN-22	買建	409	-802,194.00	
SOYBEANS (CBT) JAN-22	買建	421	-1,697,500.00	
WHEAT (CBT) MAR-22	買建	534	-320,500.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-22	買建	581	167,415.00	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) JAN-22	買建	718	-406,700.00	
CORN (CBT) MAR-22	買建	1,260	-1,091,625.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) JAN-22	買建	1,382	-1,613,390.00	

(注) L M E (ロンドン金属取引所)においては、先渡し売買となるため、期日到来まで反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年11月30日

資産総額	876,968,804円
負債総額	805,784円
純資産総額（ - ）	876,163,020円
発行済数量	938,500,251口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9336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

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

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

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

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

資産総額	1,391,304,310円
負債総額	0円
純資産総額( - )	1,391,304,310円
発行済数量	684,670,573口
1単位当たり純資産額( / )	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

資産総額	675,803,683円
負債総額	2,000,000円
純資産総額( - )	673,803,683円

発行済数量	242,296,583口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.7809円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年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年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年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、改訂府令附則第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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		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いません。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

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

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

(注記に関する表示方法の変更)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日

効力発生日

2021年6月23日

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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

## （3）金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## （ ）為替変動リスクの管理

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

## （ ）価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表さ

れている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

#### 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年3月31日）

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

#### 2．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	60	55	5
（2）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

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

当事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	85	55	30

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度(退職一時金制度であります)及び確定拠出制度を採用していません。

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度181百万円、当事業年度186百万円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 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	(株)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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	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	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	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いません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 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		
ソフトウェア		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

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	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
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いません。

(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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	九州FG証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	(注3)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,912千円 (2020年12月31日現在)		
	コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	535千米ドル (2020年12月31日現在)		

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

### 第3【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年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」に掲げられているダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンドの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、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンドの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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。