

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年8月3日提出
【計算期間】	第82計算期間（自 2020年11月10日 至 2021年5月10日）
【ファンド名】	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、内外の公社債、不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行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、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

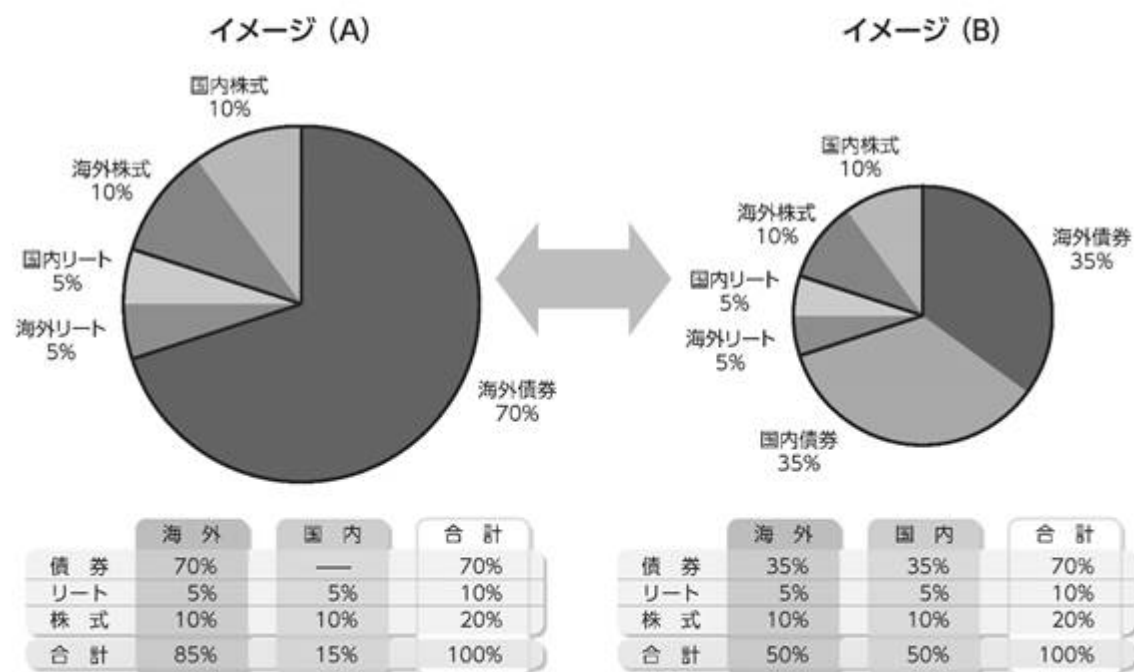
## 1

### 内外の公社債、リートおよび株式に投資します。

- 各資産の組入比率については、下記イメージ（A）の組入比率を目処とします。

ただし、毎年6月末において、「ダイワ日本国債マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りが「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りを上回った場合は、下記イメージ（B）の組入比率を目処とします。

- 2021年5月末現在、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りは、「ダイワ日本国債マザーファンド」のポートフォリオの最終利回りを上回っています。



(注1) 上記は、イメージであり、実際の組入比率とは異なります。

(注2) 市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



(注) 組入れについては、前記1.をご参照下さい。

## 2

## 海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

## ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上<sup>※1</sup>、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上<sup>※2</sup>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。

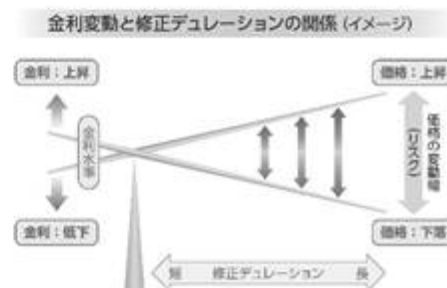
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※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。



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



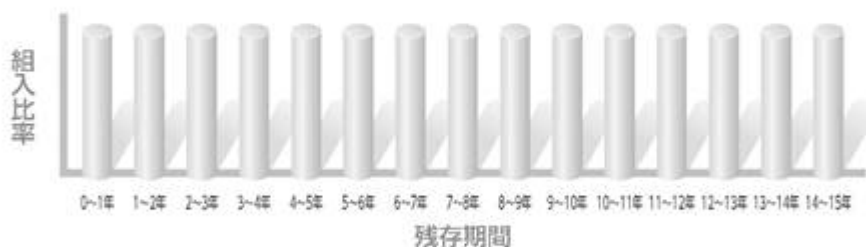
## 3

## わが国の公社債への投資にあたっては、国債に投資します。

※2021年5月末現在、わが国の国債には投資していません。

- 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。

- 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。

## 4

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

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

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

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



## 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 〈コーヘン&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。
- ・ リート運用では最大級の資産規模。
- ・ ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- ・ 優先リートを含むハイブリッド証券などのインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- ・ 所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

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

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 5

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

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

## 投資対象の地域別構成

(イメージ)



## 好配当株とは

(イメージ)



- ◆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&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。
- ◆北米の株式への投資にあたっては、株式のほかハイブリッド優先証券<sup>®</sup>を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

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

- ◆欧州の株式の運用にあたっては、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。

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

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

## 〈アムンディ・アイルランド・リミテッドについて〉

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

## 6

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

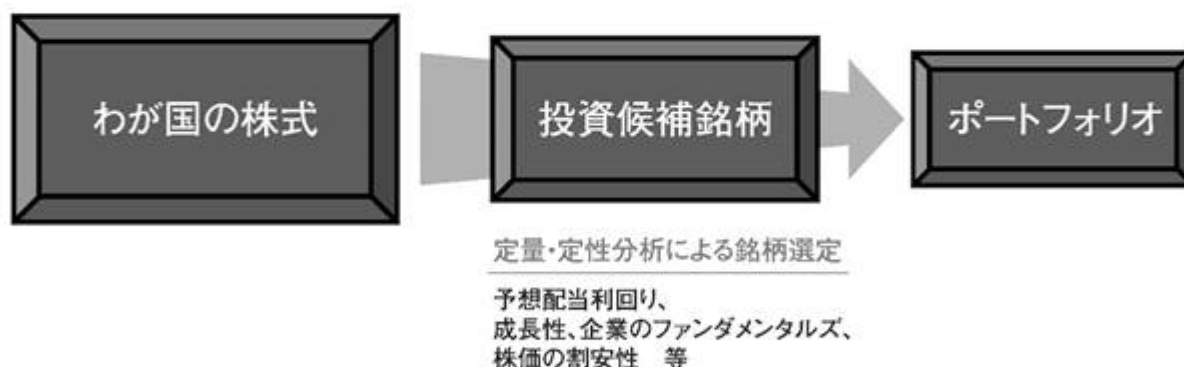
## 投資対象のイメージ



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

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

## 銘柄選定プロセス



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

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

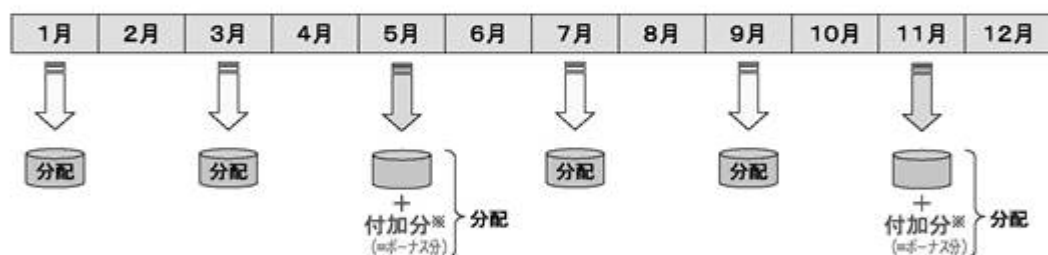
## 7

毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11月）の各8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

## 〈分配方針〉

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。5月と11月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

## 収益分配のイメージ



※5月と11月に付加できない場合があります。

- ◆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。

## 【収益分配金に関する留意事項】

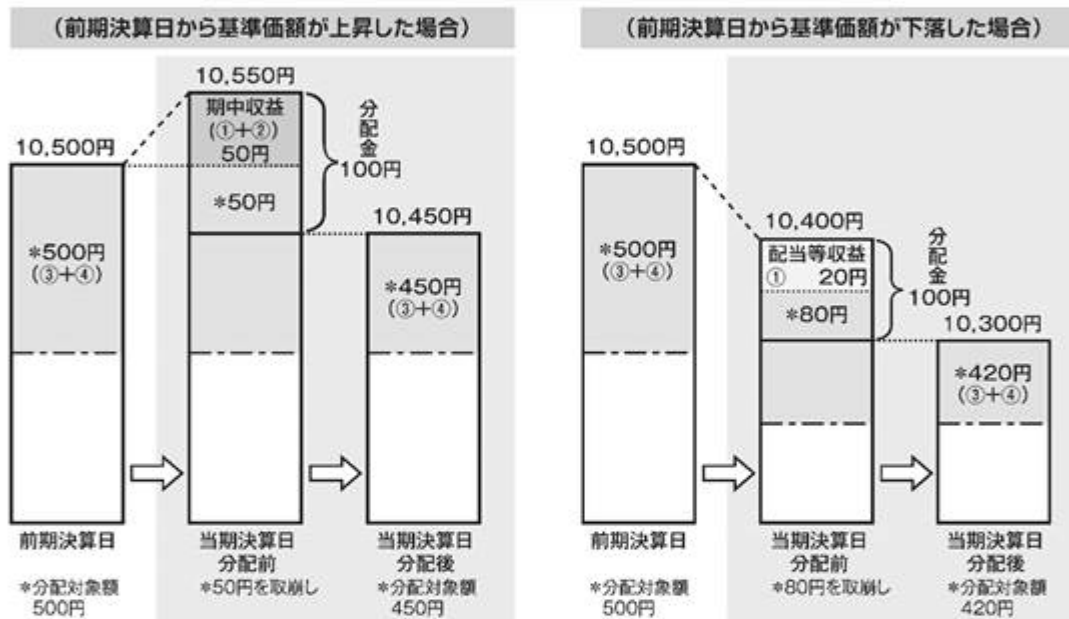
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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）



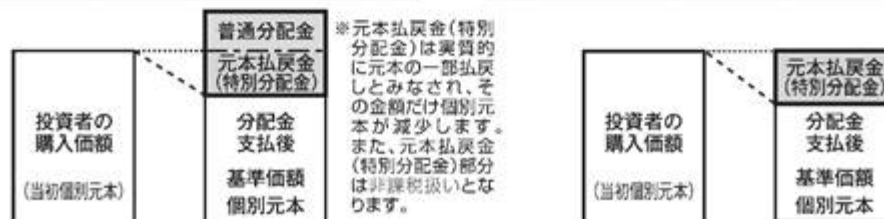
(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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がか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】

2007年6月22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>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <p>ファミリーファンド方式で運用を行ないません。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）</li> <li>・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&amp;ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）</li> <li>・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）</li> </ul>	

（注1）「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5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

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

#### 1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券



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

#### 投資態度

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

ロ. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の70%
ダイワ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0%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...	信託財産の純資産総額の5%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券	...信託財産の純資産総額の5%
ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券	...信託財産の純資産総額の3.3%
ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券.....	信託財産の純資産総額の10%

ただし、毎年6月末において、ダイワ日本国債マザーファンドのポートフォリオの最終利回りがダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのポートフォリオの最終利回りを上回った場合は、ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド受益証券の標準組入比率を信託財産の純資産総額の35%程度とし、ダイワ日本国債マザーファンド受益証券の標準組入比率を信託財産の純資産総額の35%程度とします。また、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。

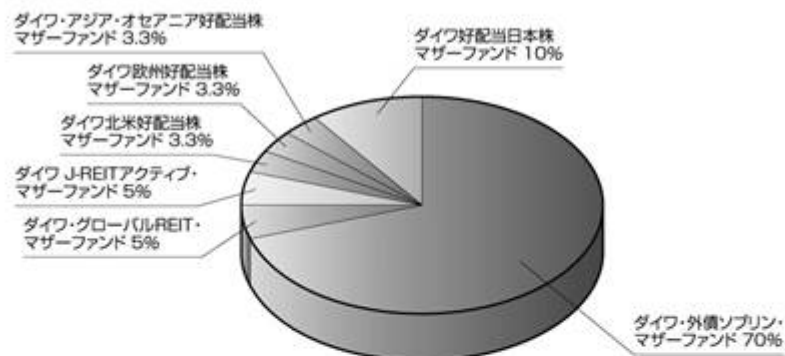
ハ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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。

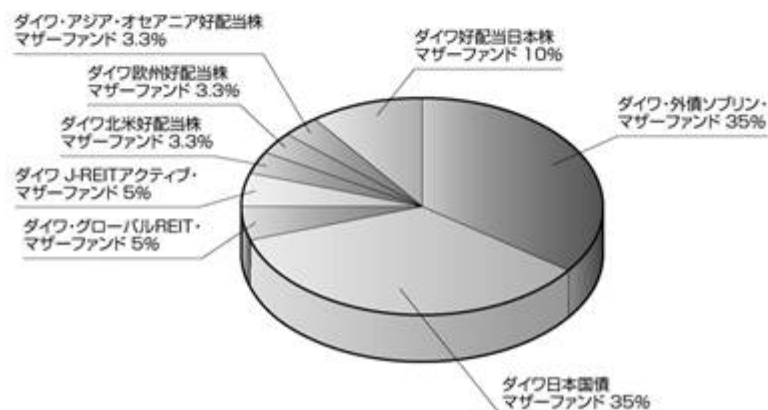
## 〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

ファンドにおける各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。



◆毎年6月末において、「ダイワ日本国債マザーファンド」の最終利回りが、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の最終利回りを上回った場合



## (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します。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

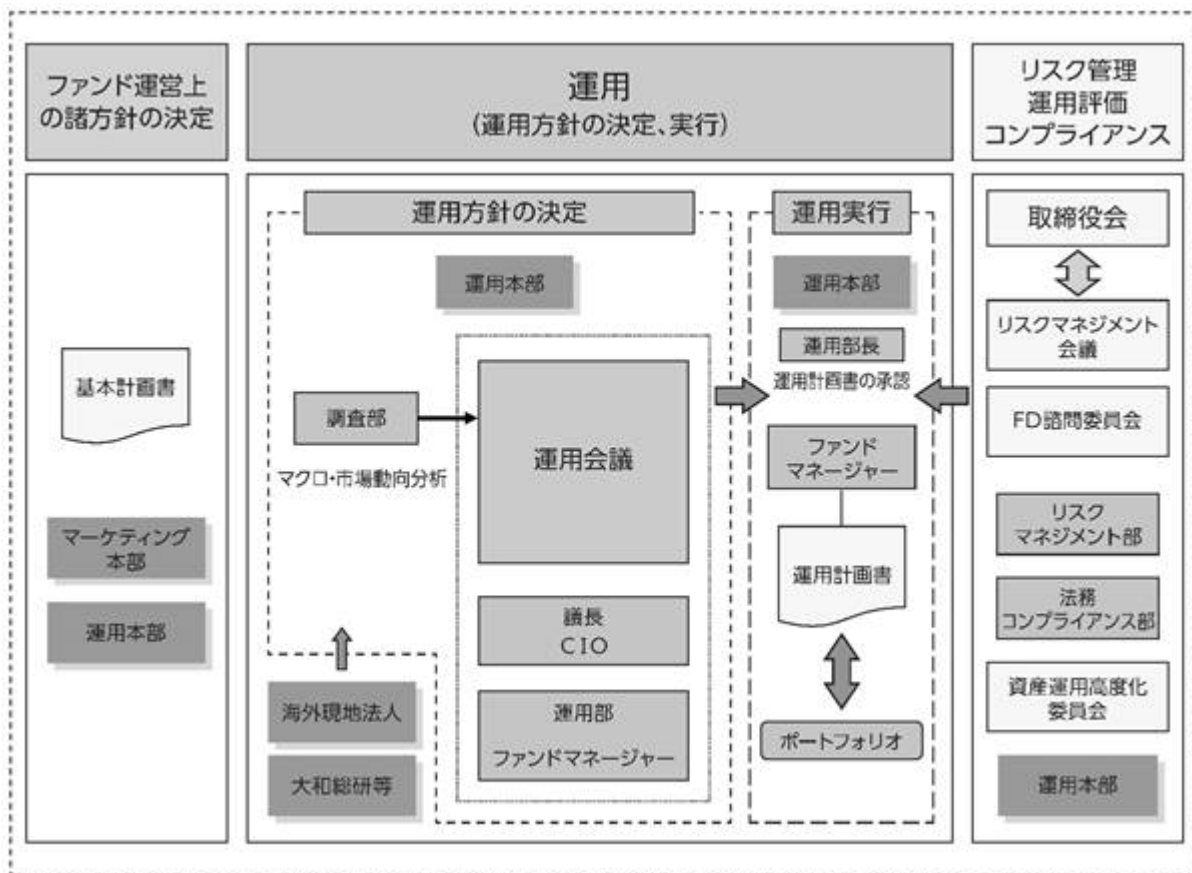
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



#### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

##### イ．基本計画書の策定

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

##### ロ．基本的な運用方針の決定

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

##### 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40～50名程度です。

##### イ．リスクマネジメント会議

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

##### ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

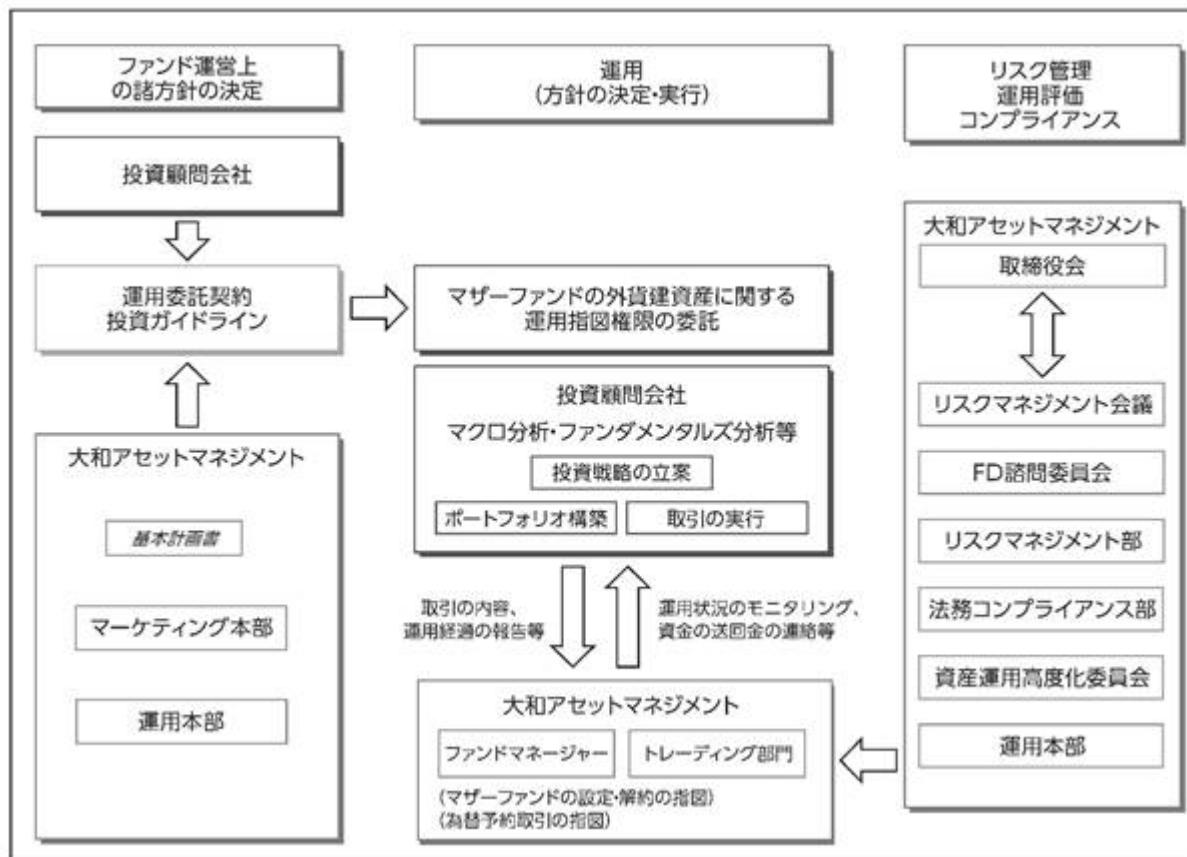
##### ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

#### 受託会社に対する管理体制

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

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



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

#### ロ．運用の実行

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

#### ハ．モニタリング

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

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

#### ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2021年5月31日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4)【配分方針】

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

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。5月と11月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

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。

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。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの概要

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

## 投資態度

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

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

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

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

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

イ．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。 ）。

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

ハ．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。

ニ．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。

ヘ．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。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

## 八．約束手形

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

- 1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．コマーシャル・ペーパー
- 8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
- 9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 10．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 13．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 14．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 15．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

#### 1．預金



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

### (3) 主な投資制限

株式への投資は、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、)の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、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。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 2. ダイワ日本国債マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

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

- 1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）
- 2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

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

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

2. ~ 16. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

スワップ取引

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

ロ. ~ 八. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

ホ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

金利先渡取引

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

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

ハ. (ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

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

## 3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

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

#### 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## (4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

#### 4. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

## (2) 投資対象

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

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

以下同じ。）

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

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

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

## 5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

## (1) 投資方針

## &lt;ダイワ北米好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

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

## &lt;ダイワ欧州好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

## &lt;ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド&gt;

## 主要投資対象

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

## 投資態度

- イ．主として、アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象として、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。
- ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）
- ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）
- ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）
- ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

## (2) 投資対象

### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）
  - ハ．約束手形
  - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

- 1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券



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

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

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

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

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

### (3) 主な投資制限

#### <各ファンド共通>

株式への投資割合には、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。

先物取引等

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

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

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

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

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

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

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

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

引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### (4) 運用指図権限の委託

##### <ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

アムンディ・アイルランド・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

##### <ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

## 8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。
- ロ．株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。
- ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。
- ニ．J-REIT（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

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

## (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．株券または新株引受権証券

2．～10．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12．～20．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

## (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、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。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3

号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

### 金利先渡取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとし、
- ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとし、
- ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとし、

## 3【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

## 〈基準価額の主な変動要因〉

株価変動リスク	株式市況	株 価	基準価額
	改 善	➡	上昇要因
	悪 化	➡	下落要因
公社債の 価格変動リスク	金 利	公社債価格	基準価額
	低 下	➡	上昇要因
	上 昇	➡	下落要因
リート の 価格変動リスク	リート市況	リート価格	基準価額
	改 善	➡	上昇要因
	悪 化	➡	下落要因
外貨建資産の 為替リスク	為替相場	円換算価値	基準価額
	円 安	➡	上昇要因
	円 高	➡	下落要因

○当ファンドの各資産の組入比率は標準組入比率を目処に決定されます。配分が大きい資産が下落する場合、他の資産が上昇しても、当ファンドの基準価額は下落する場合があります。

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

## 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）

## 〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



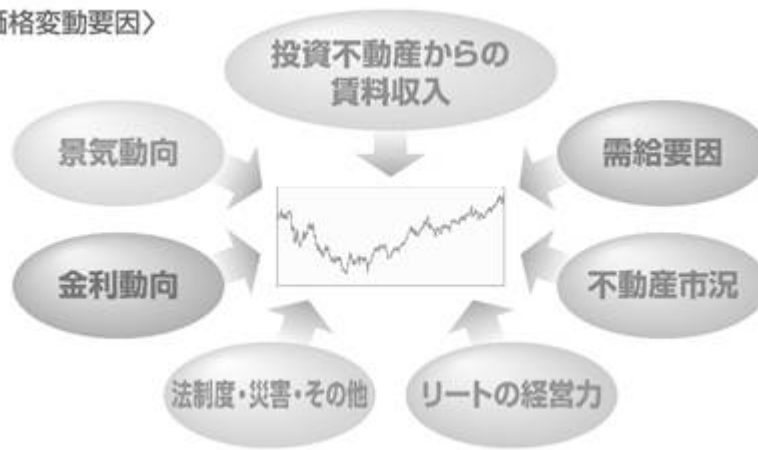
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

## リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク



## 〈リートの価格変動要因〉



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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

### 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

#### (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

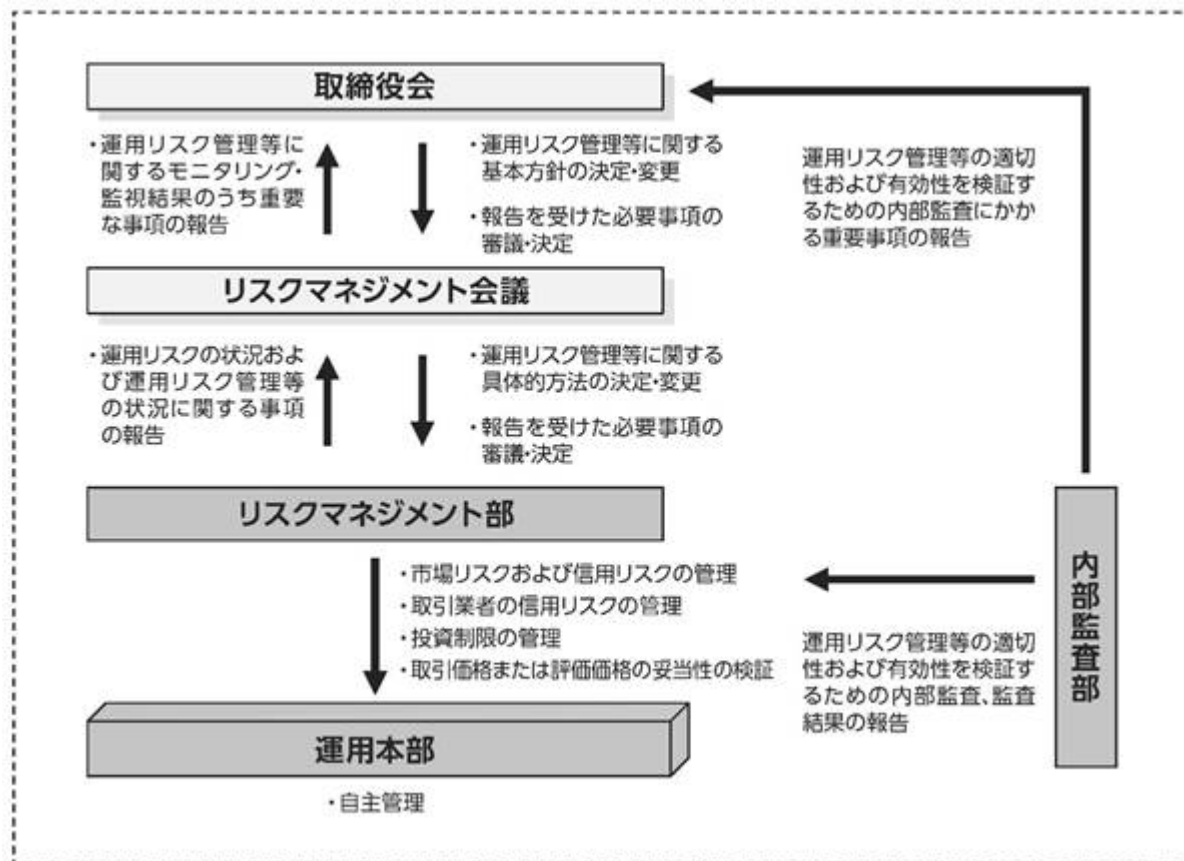
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

#### (3)その他の留意点

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

#### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



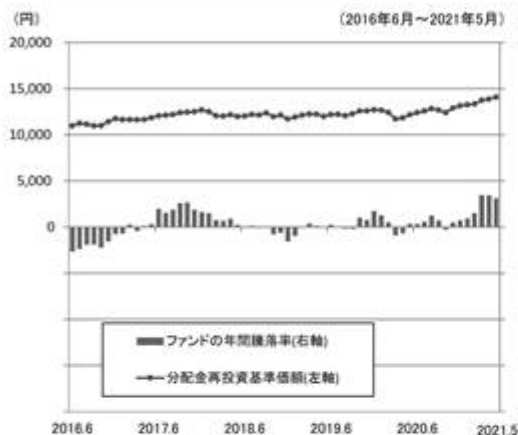
#### 流動性リスクに対する管理体制

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

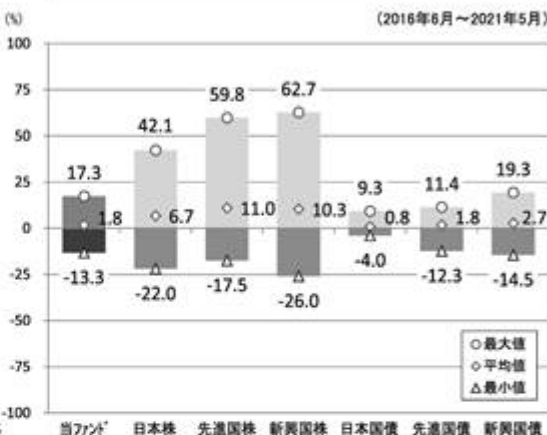
## 参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

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

## (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1.4025% (税抜1.275%) 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、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社 (各販売会社の 取扱純資産総額 に応じて)	受託会社
100億円以下の部分	年率1.275% (税抜) から 販売会社、受託会社分を除 いた額	年率0.65% (税抜)	年率0.05% (税抜)
100億円超 200億円以下の部分		年率0.70% (税抜)	
200億円超 500億円以下の部分		年率0.75% (税抜)	
500億円超 1,000億円以下の部分		年率0.80% (税抜)	
1,000億円超の部分		年率0.85% (税抜)	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

### イ. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。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。

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

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

各マザーファンドの日々の純資産総額にそれぞれ年率0.5%を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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。

#### 八．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5月31日現在のもので、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5月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,035,438,658	99.19
内 日本	2,035,438,658	99.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,683,545	0.81
純資産総額	2,052,122,203	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5月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	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	747,399,447	1.8940 1,415,574,607	1.9109 1,428,205,603	69.60
2	ダイワ好配当日本株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	61,475,752	3.3070 203,302,521	3.2774 201,480,629	9.82
3	ダイワ・グローバルREIT・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	31,668,508	3.1668 100,287,832	3.2288 102,251,278	4.98
4	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	28,963,633	3.4325 99,417,671	3.4695 100,489,324	4.90
5	ダイワ欧州好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	33,210,934	2.0103 66,763,941	2.0416 67,803,442	3.30
6	ダイワ北米好配当株マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	17,282,015	3.9054 67,493,181	3.9198 67,742,042	3.30

7	ダイワ・アジア・オセアニア好配 当株マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	22,722,060	2.9720 67,529,962	2.9692 67,466,340	3.29
---	------------------------------	----	-------------------	------------	----------------------	----------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.19%
合計	99.19%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第9特定期間末 (2011年11月8日)	8,138,958,045	8,169,641,971	0.6631	0.6656
第10特定期間末 (2012年5月8日)	7,463,333,638	7,490,331,852	0.6911	0.6936
第11特定期間末 (2012年11月8日)	6,752,954,650	6,777,072,905	0.7000	0.7025
第12特定期間末 (2013年5月8日)	7,693,068,615	7,714,023,613	0.9178	0.9203
第13特定期間末 (2013年11月8日)	6,323,909,498	6,342,033,496	0.8723	0.8748
第14特定期間末 (2014年5月8日)	5,716,045,140	5,731,474,692	0.9262	0.9287

第15特定期間末 (2014年11月10日)	5,412,013,512	5,436,066,692	1.0125	1.0170
第16特定期間末 (2015年5月8日)	4,645,698,964	4,665,887,169	1.0355	1.0400
第17特定期間末 (2015年11月9日)	4,083,772,554	4,102,287,781	0.9925	0.9970
第18特定期間末 (2016年5月9日)	3,536,950,209	3,554,557,201	0.9040	0.9085
第19特定期間末 (2016年11月8日)	3,158,926,906	3,175,478,409	0.8588	0.8633
第20特定期間末 (2017年5月8日)	3,188,896,789	3,204,615,832	0.9129	0.9174
第21特定期間末 (2017年11月8日)	3,086,353,661	3,100,873,144	0.9565	0.9610
第22特定期間末 (2018年5月8日)	2,750,661,830	2,764,329,390	0.9056	0.9101
第23特定期間末 (2018年11月8日)	2,568,327,844	2,581,250,207	0.8944	0.8989
第24特定期間末 (2019年5月8日)	2,364,512,853	2,376,629,850	0.8781	0.8826
第25特定期間末 (2019年11月8日)	2,269,113,027	2,280,511,298	0.8958	0.9003
第26特定期間末 (2020年5月8日)	1,989,214,455	2,000,025,154	0.8280	0.8325
2020年5月末日	2,052,712,279	-	0.8576	-
6月末日	2,076,812,329	-	0.8720	-
7月末日	2,099,321,654	-	0.8816	-
8月末日	2,101,410,161	-	0.8991	-
9月末日	2,041,461,250	-	0.8865	-
10月末日	1,987,592,386	-	0.8668	-
第27特定期間末 (2020年11月9日)	2,018,179,556	2,025,060,036	0.8800	0.8830
11月末日	2,046,467,061	-	0.8987	-
12月末日	2,051,009,605	-	0.9165	-
2021年1月末日	2,046,084,004	-	0.9203	-
2月末日	2,026,304,134	-	0.9270	-
3月末日	2,053,679,846	-	0.9510	-
4月末日	2,050,651,200	-	0.9595	-

第28特定期間末 (2021年5月10日)	2,060,620,419	2,067,026,536	0.9650	0.9680
5月末日	2,052,122,203	-	0.9713	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第9特定期間	0.0075
第10特定期間	0.0075
第11特定期間	0.0075
第12特定期間	0.0075
第13特定期間	0.0075
第14特定期間	0.0075
第15特定期間	0.0135
第16特定期間	0.0135
第17特定期間	0.0135
第18特定期間	0.0135
第19特定期間	0.0135
第20特定期間	0.0135
第21特定期間	0.0135
第22特定期間	0.0135
第23特定期間	0.0135
第24特定期間	0.0135
第25特定期間	0.0135
第26特定期間	0.0135
第27特定期間	0.0090
第28特定期間	0.0090

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第9特定期間	4.5
第10特定期間	5.4
第11特定期間	2.4
第12特定期間	32.2
第13特定期間	4.1
第14特定期間	7.0
第15特定期間	10.8
第16特定期間	3.6
第17特定期間	2.8
第18特定期間	7.6

第19特定期間	3.5
第20特定期間	7.9
第21特定期間	6.3
第22特定期間	3.9
第23特定期間	0.3
第24特定期間	0.3
第25特定期間	3.6
第26特定期間	6.1
第27特定期間	7.4
第28特定期間	10.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9特定期間	56,258,535	1,727,513,794
第10特定期間	39,112,672	1,513,397,602
第11特定期間	38,051,911	1,190,035,382
第12特定期間	40,474,871	1,305,777,564
第13特定期間	36,473,196	1,168,873,230
第14特定期間	28,614,946	1,106,393,289
第15特定期間	68,251,750	894,921,721
第16特定期間	37,102,265	895,985,499
第17特定期間	40,042,104	411,815,026
第18特定期間	21,729,050	223,559,115
第19特定期間	17,803,625	252,356,607
第20特定期間	20,579,254	205,570,442
第21特定期間	30,847,029	297,415,976
第22特定期間	39,161,512	228,477,630
第23特定期間	16,617,165	182,216,569
第24特定期間	21,371,056	200,341,184
第25特定期間	17,760,272	177,477,237
第26特定期間	13,452,966	144,024,579
第27特定期間	36,163,579	145,047,794
第28特定期間	12,761,643	170,882,422

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		19,757,808,283	93.71
	内 ユーロ	5,022,542,265	23.82
	内 ノルウェー	278,805,248	1.32
	内 スウェーデン	385,824,755	1.83
	内 デンマーク	744,823,298	3.53
	内 イギリス	2,699,093,904	12.80
	内 ポーランド	1,437,539,065	6.82
	内 カナダ	1,721,243,934	8.16
	内 アメリカ	4,868,847,188	23.09
内 オーストラリア	2,599,088,626	12.33	
特殊債券		1,020,488,213	4.84
	内 カナダ	1,020,488,213	4.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		304,883,565	1.45
純資産総額		21,083,180,061	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)		267,586,235	1.27
	内 日本	267,586,235	1.27
為替予約取引(売建)		285,181,408	1.35
	内 日本	285,181,408	1.35

(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5月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額				
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	27,183,400	93.17	94.08	0.875000 2030/11/15	13.31

2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債 証券	19,000,000	128.84 2,070,564,919	129.41 2,079,708,862	4.500000 2033/04/21	9.86
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	17,538,800	106.41 2,048,454,949	107.09 2,061,680,102	2.250000 2027/08/15	9.78
4	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	9,136,000	109.74 1,340,966,663	109.14 1,333,623,353	1.400000 2028/04/30	6.33
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	8,660,000	111.13 1,287,117,932	110.70 1,282,114,558	1.950000 2026/04/30	6.08
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,750,400	159.08 1,010,721,841	154.55 981,922,854	3.250000 2045/05/25	4.66
7	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	11,046,000	91.22 915,110,361	91.29 915,738,421	0.500000 2030/12/01	4.34
8	Poland Government Bond	ポーランド	国債 証券	25,000,000	110.34 823,139,158	108.10 806,428,702	2.750000 2028/04/25	3.82
9	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊 債券	7,830,000	105.15 747,703,640	105.32 748,919,523	2.250000 2025/12/15	3.55
10	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	4,500,000	105.86 741,259,728	105.75 740,475,504	1.500000 2026/07/22	3.51
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	3,905,900	118.59 720,776,724	118.03 717,379,357	5.000000 2025/03/07	3.40
12	Poland Government Bond	ポーランド	国債 証券	21,093,000	100.50 632,595,786	100.26 631,110,361	1.750000 2021/07/25	2.99
13	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	6,743,000	102.66 628,632,103	102.83 629,679,190	1.500000 2026/06/01	2.99
14	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債 証券	29,000,000	110.37 575,501,682	109.77 572,388,805	1.750000 2025/11/15	2.71
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	3,200,000	107.52 535,378,521	107.48 535,164,416	1.625000 2028/10/22	2.54
16	IRISH TREASURY	ユーロ	国債 証券	3,172,000	107.52 456,146,081	106.91 453,549,835	1.000000 2026/05/15	2.15
17	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	3,095,700	93.70 451,373,293	93.58 450,809,714	0.250000 2031/07/31	2.14

18	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,387,600	110.29 352,175,407	109.07 348,292,504	1.100000 2029/05/15	1.65
19	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	169.26 339,560,510	164.55 330,109,773	3.750000 2045/06/22	1.57
20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	114.41 280,629,589	114.67 281,286,944	3.250000 2029/04/21	1.33
21	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	106.66 279,894,208	106.25 278,805,248	3.000000 2024/03/14	1.32
22	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	2,815,000	106.34 271,849,883	106.23 271,568,689	2.550000 2025/03/15	1.29
23	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	164.13 255,390,948	164.05 255,264,912	4.250000 2046/12/07	1.21
24	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,307,000	122.49 239,019,667	122.02 238,092,818	4.750000 2027/04/21	1.13
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	14,230,000	105.80 198,741,758	105.40 197,996,049	1.000000 2026/11/12	0.94
26	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	13,630,000	104.68 188,339,667	104.39 187,828,705	1.500000 2023/11/13	0.89
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	1,500,000	131.78 179,515,024	129.08 175,826,322	3.500000 2045/12/01	0.83
28	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	5,500,000	178.46 176,479,094	174.37 172,434,493	4.500000 2039/11/15	0.82
29	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,110,000	101.17 150,192,734	101.03 149,993,810	- 2026/01/31	0.71
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	695,000	158.58 147,402,717	153.77 142,935,574	2.500000 2046/08/15	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	93.71%



特殊債券	4.84%
合計	98.55%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2021年6月	買建	1,574,780	132,940,000	133,194,900	0.63%
		米ドル買/円売 2021年6月	買建	1,224,634	132,940,000	134,391,335	0.64%
		米ドル売/円買 2021年6月	売建	115,000	12,622,170	12,622,250	0.06%
		ユーロ売/円買 2021年6月	売建	2,000,000	265,880,000	267,580,000	1.27%
		英ポンド売/円買 2021年6月	売建	32,000	4,979,174	4,979,158	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	81,643,927,518	95.95
内 香港	2,839,622,390	3.34
内 シンガポール	5,946,983,175	6.99

内 イギリス	8,892,964,482	10.45
内 オランダ	729,999,682	0.86
内 ベルギー	2,870,080,662	3.37
内 フランス	5,251,848,154	6.17
内 ドイツ	550,866,313	0.65
内 スペイン	411,108,583	0.48
内 カナダ	1,547,960,359	1.82
内 アメリカ	40,335,676,196	47.40
内 オーストラリア	11,592,833,909	13.62
内 ニュージーランド	673,983,613	0.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,445,283,910	4.05
純資産総額	85,089,211,428	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)	196,271,144	0.23
内 日本	196,271,144	0.23
為替予約取引(売建)	196,223,206	0.23
内 日本	196,223,206	0.23

(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5月31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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,097,628	1,402.33 2,941,580,098	1,634.93 3,429,477,883	4.03
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	101,985	26,677.16 2,720,670,978	31,005.00 3,162,045,415	3.72
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	35,682	74,961.90 2,674,794,063	80,862.38 2,885,331,700	3.39
4	LINK REIT	香港	投資証券	2,682,992	1,015.95 2,725,809,869	1,058.37 2,839,622,390	3.34

5	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,320,540	986.20 2,288,523,046	1,197.65 2,779,201,229	3.27
6	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	11,352,750	202.99 2,304,517,428	237.66 2,698,205,822	3.17
7	KLEPIERRE	フランス	投資証券	794,727	2,840.90 2,257,762,301	3,189.69 2,534,939,917	2.98
8	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	489,078	4,470.52 2,186,435,328	5,099.44 2,494,028,611	2.93
9	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	170,220	12,990.86 2,211,305,506	14,103.06 2,400,623,282	2.82
10	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	158,871	11,117.59 1,766,262,704	12,934.11 2,054,856,324	2.41
11	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガポール	投資証券	11,974,332	175.10 2,097,367,793	169.96 2,035,223,326	2.39
12	UDR INC	アメリカ	投資証券	383,750	4,955.66 1,901,736,060	5,227.86 2,006,194,652	2.36
13	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,515,172	796.20 2,002,682,303	793.56 1,995,939,892	2.35
14	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	543,107	3,485.97 1,893,258,836	3,663.78 1,989,829,344	2.34
15	VEREIT INC	アメリカ	投資証券	360,319	4,365.48 1,573,003,620	5,221.28 1,881,327,541	2.21
16	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,122,227	1,427.78 1,602,299,560	1,623.68 1,822,144,268	2.14
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	91,460	16,217.04 1,483,210,478	18,376.01 1,680,670,716	1.98
18	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	4,578,777	339.68 1,555,681,728	363.14 1,662,763,637	1.95
19	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	100,427	14,456.48 1,451,821,881	16,443.14 1,651,335,783	1.94
20	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	198,334	7,230.98 1,434,150,933	8,094.80 1,605,474,063	1.89
21	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	262,074	6,206.92 1,626,674,449	6,086.19 1,595,032,682	1.87
22	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	828,506	1,891.16 1,566,915,602	1,884.57 1,561,385,175	1.83
23	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	384,355	3,783.14 1,454,070,543	4,027.42 1,547,960,359	1.82
24	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	448,229	3,130.35 1,403,115,981	3,416.82 1,531,521,756	1.80

25	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	88,566	14,810.35 1,311,700,685	16,635.22 1,473,315,390	1.73
26	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	44,197	31,593.31 1,396,329,893	32,411.03 1,432,470,311	1.68
27	AEDIFICA	ベルギー	投資証券	85,962	13,173.39 1,132,410,951	14,216.56 1,222,084,103	1.44
28	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	5,423,641	213.99 1,160,745,533	213.07 1,155,662,374	1.36
29	ICADE	フランス	投資証券	111,508	8,358.75 932,067,495	9,870.01 1,100,585,298	1.29
30	KEPPEL REIT	シンガポール	投資証券	11,368,100	97.33 1,107,168,771	96.17 1,093,333,838	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.95%
合計	95.95%

(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	英ポンド買/円売 2021年6月	買建	80,452	12,574,751	12,518,349	0.01%
		米ドル買/円売 2021年6月	買建	1,272,384	139,532,709	139,655,221	0.16%
		ユーロ買/円売 2021年6月	買建	329,722	44,141,285	44,097,574	0.05%
		英ポンド売/円買 2021年6月	売建	896,740	139,532,709	139,531,544	0.16%

	米ドル売/円買 2021年6月	売建	516,509	56,716,036	56,691,662	0.07%
--	-----------------	----	---------	------------	------------	-------

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	112,594,268,700	96.46
内 日本	112,594,268,700	96.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,131,515,510	3.54
純資産総額	116,725,784,210	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,488,200,000	2.13
内 日本	2,488,200,000	2.13

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

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

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

### (2) 投資資産 (2021年5月31日現在)

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	13,268	678,231.97 8,998,781,904	660,000.00 8,756,880,000	7.50
2 日本ビルファンド	日本	投資証券	12,209	700,958.82 8,558,006,319	694,000.00 8,473,046,000	7.26

3	日本プロロジスリート	日本	投資証券	19,283	347,764.98 6,705,952,237	339,500.00 6,546,578,500	5.61
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	37,708	171,642.51 6,472,295,938	173,400.00 6,538,567,200	5.60
5	GLP投資法人	日本	投資証券	30,875	179,321.92 5,536,564,403	186,900.00 5,770,537,500	4.94
6	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	16,532	298,513.34 4,935,022,637	306,000.00 5,058,792,000	4.33
7	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	45,650	110,685.73 5,052,804,004	110,800.00 5,058,020,000	4.33
8	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	13,098	352,919.31 4,622,537,129	352,000.00 4,610,496,000	3.95
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	18,708	191,575.57 3,583,995,858	203,500.00 3,807,078,000	3.26
10	森ヒルズリート	日本	投資証券	22,178	157,186.02 3,486,071,740	157,800.00 3,499,688,400	3.00
11	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	5,013	641,541.13 3,216,045,705	634,000.00 3,178,242,000	2.72
12	産業ファンド	日本	投資証券	15,382	197,584.27 3,039,241,325	196,000.00 3,014,872,000	2.58
13	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	15,639	174,661.49 2,731,531,191	178,500.00 2,791,561,500	2.39
14	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	12,249	221,300.00 2,710,703,700	225,200.00 2,758,474,800	2.36
15	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	17,056	164,326.63 2,802,755,054	157,000.00 2,677,792,000	2.29
16	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	5,837	453,022.94 2,644,294,919	457,500.00 2,670,427,500	2.29
17	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	25,779	89,615.52 2,310,198,563	90,600.00 2,335,577,400	2.00
18	日本リート投資法人	日本	投資証券	5,207	427,500.00 2,225,992,500	445,500.00 2,319,718,500	1.99
19	イオンリート投資	日本	投資証券	14,525	150,306.05 2,183,195,400	154,100.00 2,238,302,500	1.92
20	API投資法人	日本	投資証券	4,260	497,750.32 2,120,416,368	498,500.00 2,123,610,000	1.82
21	三井不ロジパーク	日本	投資証券	3,678	555,115.20 2,041,713,723	562,000.00 2,067,036,000	1.77
22	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	6,865	275,627.60 1,892,183,515	283,900.00 1,948,973,500	1.67

23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	10,907	172,721.97 1,883,878,622	174,900.00 1,907,634,300	1.63
24	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	2,327	792,326.40 1,843,743,553	812,000.00 1,889,524,000	1.62
25	東急リアル・エステート	日本	投資証券	9,626	184,500.00 1,775,997,000	193,400.00 1,861,668,400	1.59
26	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	39,427	42,550.00 1,677,618,850	44,600.00 1,758,444,200	1.51
27	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	3,998	430,858.22 1,722,571,201	430,500.00 1,721,139,000	1.47
28	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,080	778,000.00 1,618,240,000	778,000.00 1,618,240,000	1.39
29	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	9,259	151,800.00 1,405,516,200	157,200.00 1,455,514,800	1.25
30	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	19,614	64,600.00 1,267,064,400	67,200.00 1,318,060,800	1.13

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.46%
合計	96.46%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 030 6月	買建	1,200	2,462,470,360	2,488,200,000	2.13%

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

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

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

### (1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,961,506,270	80.36
内 カナダ	15,373,244	0.42
内 アメリカ	2,946,133,026	79.94
ハイブリッド優先証券	513,194,337	13.93
内 アメリカ	513,194,337	13.93
投資証券	22,998,398	0.62
内 アメリカ	22,998,398	0.62
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	187,633,477	5.09
純資産総額	3,685,332,482	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5月31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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	12,174	14,491.61 176,420,894	13,677.19 166,506,155	4.52
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,555	28,053.55 155,837,517	27,404.87 152,234,091	4.13
3	FIRSTENERGY CORP	アメリカ	株式	公益事業	25,377	3,859.16 97,933,944	4,161.00 105,593,738	2.87



4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	298	365,830.08 109,017,364	353,764.16 105,421,721	2.86
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	5,810	16,596.80 96,427,464	18,026.98 104,736,768	2.84
6	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	2,882	33,237.52 95,790,542	36,081.40 103,986,609	2.82
7	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	アメリカ	株式	情報技術	1,642	54,951.34 90,230,107	54,556.20 89,581,294	2.43
8	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,438	24,364.52 83,765,236	24,948.44 85,772,764	2.33
9	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	2,010	41,524.40 83,464,050	39,577.26 79,550,294	2.16
10	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	12,153	6,333.15 76,966,796	6,200.34 75,352,761	2.04
11	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	8,018	9,951.93 79,794,649	9,235.20 74,047,885	2.01
12	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	15,477	4,377.22 67,746,370	4,652.72 72,010,246	1.95
13	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,292	56,046.74 72,412,399	55,382.70 71,554,449	1.94
14	RENEWABLE ENERGY GROUP INC	アメリカ	株式	エネルギー	10,006	6,928.49 69,327,454	6,703.04 67,070,650	1.82
15	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	1,228	52,388.44 64,333,014	51,842.94 63,663,131	1.73
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,977	17,552.81 52,254,743	18,576.88 55,303,372	1.50
17	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,275	19,340.80 44,000,342	23,554.49 53,586,478	1.45
18	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	アメリカ	株式	金融	2,473	19,684.35 48,679,418	21,368.07 52,843,254	1.43
19	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	4,628	8,867.51 41,038,838	9,982.67 46,199,806	1.25

20	GOLDMAN SACHS GROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,126	36,808.01 41,445,826	40,832.91 45,977,863	1.25
21	NORFOLK SOUTHERN CORP	アメリカ	株式	資本 財・サー ビス	1,443	29,837.15 43,055,020	30,831.58 44,489,976	1.21
22	TYSON FOODS INC-CL A	アメリカ	株式	生活必 需品	5,086	8,589.81 43,687,812	8,725.92 44,380,029	1.20
23	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	3,178	13,599.26 43,218,461	13,894.51 44,156,779	1.20
24	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	アメリカ	株式	金融	3,434	12,972.53 44,547,683	12,389.70 42,546,260	1.15
25	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本 財・サー ビス	2,544	15,392.74 39,159,137	15,942.64 40,558,076	1.10
26	WILLIS TOWERS WATSON PLC	アメリカ	株式	金融	1,367	25,982.38 35,517,923	28,686.87 39,214,956	1.06
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	760	52,469.67 39,876,950	51,532.32 39,164,563	1.06
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必 需品	3,461	10,246.09 35,461,933	10,584.15 36,631,767	0.99
29	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・サ ービス	1,032	35,125.39 36,249,408	35,003.56 36,123,676	0.98
30	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーション・サ ービス	1,801	20,575.60 37,056,673	19,608.62 35,315,132	0.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	80.36%
ハイブリッド優先証券	13.93%
投資証券	0.62%
合計	94.91%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
----	------

エネルギー	3.89%
素材	2.18%
資本財・サービス	8.35%
一般消費財・サービス	7.07%
生活必需品	3.84%
ヘルスケア	8.80%
金融	10.95%
情報技術	23.44%
コミュニケーション・サービス	8.32%
公益事業	3.54%
合計	80.36%

(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5月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,369,384,908	96.79
	内 スウェーデン	7,764,076	0.55
	内 イギリス	282,140,482	19.94
	内 オランダ	143,942,080	10.17
	内 フランス	270,494,473	19.12
	内 ドイツ	283,746,453	20.05
	内 スイス	256,975,997	18.16
	内 スペイン	22,021,916	1.56
	内 イタリア	102,299,431	7.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		45,462,211	3.21
純資産総額		1,414,847,119	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5月31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	13,083.38 72,979,100	13,546.63 75,563,153	5.34
2	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	1,137.99 54,797,808	1,089.04 52,440,774	3.71
3	DEUTSCHE POST AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	6,823	6,434.23 43,900,761	7,456.00 50,872,322	3.60
4	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	2,895	17,763.34 51,424,889	17,469.11 50,573,099	3.57
5	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,313	37,664.09 49,452,956	38,474.79 50,517,407	3.57
6	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	18,557.76 51,961,735	18,041.52 50,516,273	3.57
7	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	コミュニケーション・サービス	21,145	2,149.20 45,444,872	2,284.81 48,312,395	3.41
8	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	7,785	6,667.60 51,907,325	6,198.18 48,252,833	3.41
9	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	95	468,743.95 44,530,675	490,687.75 46,615,336	3.29
10	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,893	11,234.16 43,734,585	11,763.77 45,796,358	3.24
11	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	2,117	19,847.01 42,016,133	20,194.74 42,752,265	3.02
12	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	9,738.17 42,740,832	9,704.03 42,591,014	3.01
13	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	903	46,228.27 41,744,130	46,167.31 41,689,087	2.95

14	CAPGEMINI SE	フランス	株式	情報技術	1,883	20,194.74 38,026,695	20,535.77 38,668,868	2.73
15	AXA SA	フランス	株式	金融	12,126	3,157.60 38,289,075	3,049.94 36,983,581	2.61
16	MICHELIN (CGDE)	フランス	株式	一般消費財・サービス	2,155	16,443.33 35,435,383	16,797.74 36,199,138	2.56
17	BAYERISCHE MOTORENWERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	11,663.46 34,943,742	11,663.46 34,943,742	2.47
18	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,426.58 36,020,183	2,335.55 34,668,993	2.45
19	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,145	29,055.01 33,267,992	29,121.88 33,344,558	2.36
20	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,006.61 31,905,220	2,091.57 33,256,046	2.35
21	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,676	9,490.19 34,885,940	8,980.64 33,012,836	2.33
22	MUENCHENER RUECKVERAG-REG	ドイツ	株式	金融	1,037	35,013.13 36,308,618	31,576.01 32,744,327	2.31
23	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	100,555	305.06 30,675,402	322.17 32,396,775	2.29
24	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	コミュニケーション・サービス	87,929	379.55 33,373,814	366.18 32,197,852	2.28
25	TOTAL SE	フランス	株式	エネルギー	6,299	5,121.57 32,260,790	5,101.51 32,134,425	2.27
26	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	667.36 28,966,457	708.44 30,749,425	2.17
27	TESCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	88,445	353.83 31,294,884	347.37 30,723,758	2.17
28	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	6,951.80 27,737,703	7,553.63 30,139,004	2.13
29	UNILEVER PLC	イギリス	株式	生活必需品	4,489	6,409.16 28,770,737	6,576.43 29,521,611	2.09
30	M&G PLC	イギリス	株式	金融	68,765	342.32 23,539,635	380.44 26,161,093	1.85

(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	96.79%
合計	96.79%

(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	5.25%
素材	8.65%
資本財・サービス	10.74%
一般消費財・サービス	5.58%
生活必需品	11.06%
ヘルスケア	15.58%
金融	22.96%
情報技術	2.73%
コミュニケーション・サービス	7.12%
公益事業	7.11%
合計	96.79%

(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5月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	694,939,566	96.28
内 韓国	177,282,360	24.56

内 中国	38,457,908	5.33
内 台湾	180,470,291	25.00
内 香港	84,539,808	11.71
内 シンガポール	25,846,031	3.58
内 オーストラリア	188,343,168	26.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	26,826,913	3.72
純資産総額	721,766,479	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5月31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	2,424.13 63,027,432	2,336.99 60,761,740	8.42
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	6,900	8,265.60 57,032,640	7,881.84 54,384,696	7.53
3	BHP GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	8,800	3,891.52 34,245,427	4,073.37 35,845,681	4.97
4	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	8,000	3,822.36 30,578,920	3,806.52 30,452,168	4.22
5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	3,050	7,426.12 22,649,678	8,505.36 25,941,363	3.59
6	AIA GROUP LTD	香港	株式	金融	17,600	1,398.44 24,612,650	1,459.24 25,682,765	3.56
7	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	2,000	13,480.80 26,961,600	12,300.00 24,600,000	3.41
8	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	10,400	2,259.97 23,503,767	2,291.27 23,829,231	3.30
9	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	10,300	2,142.41 22,066,837	2,237.98 23,051,264	3.19
10	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港	株式	金融	3,400	6,524.19 22,182,266	6,750.43 22,951,482	3.18

11	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	一般消費財・サービス	4,700	4,657.82 21,891,757	4,696.72 22,074,619	3.06
12	KB FINANCIAL GROUP INC	韓国	株式	金融	3,500	5,234.88 18,322,080	5,608.80 19,630,800	2.72
13	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	87,000	208.74 18,160,789	207.55 18,057,407	2.50
14	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	3,400	4,049.16 13,767,144	4,482.12 15,239,208	2.11
15	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	5,800	2,378.68 13,796,390	2,521.29 14,623,500	2.03
16	MERIDA INDUSTRY CO LTD	台湾	株式	一般消費財・サービス	11,000	1,398.23 15,380,563	1,271.48 13,986,291	1.94
17	NAVER CORP	韓国	株式	コミュニケーション・サービス	390	38,523.60 15,024,204	35,227.20 13,738,608	1.90
18	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	143,000	93.04 13,304,892	90.49 12,940,928	1.79
19	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	1,000	13,136.11 13,136,120	12,895.91 12,895,913	1.79
20	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	141,000	87.53 12,342,872	91.10 12,845,523	1.78
21	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	香港	株式	資本財・サービス	6,000	1,973.94 11,843,664	2,068.68 12,412,092	1.72
22	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	500	22,650.52 11,325,262	24,453.76 12,226,885	1.69
23	POSCO	韓国	株式	素材	330	33,308.40 10,991,772	35,128.80 11,592,504	1.61
24	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費財・サービス	500	22,878.00 11,439,000	22,828.80 11,414,400	1.58
25	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	85,000	126.35 10,740,252	131.10 11,144,274	1.54



26	SANDS CHINA LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	20,800	521.05 10,838,027	502.67 10,455,682	1.45
27	SUN HUNG KAI PROPERTIES	香港	株式	不動産	6,000	1,713.21 10,279,340	1,713.76 10,282,608	1.42
28	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	23,000	481.26 11,069,015	439.67 10,112,433	1.40
29	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	中国	株式	生活必需品	260	35,290.89 9,175,632	38,445.86 9,995,926	1.38
30	FORTESCUE METALS GROUP LTD	オーストラリア	株式	素材	4,200	1,711.89 7,189,977	1,870.90 7,857,820	1.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.28%
合計	96.28%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	0.44%
素材	11.73%
資本財・サービス	2.30%
一般消費財・サービス	13.18%
生活必需品	3.27%
ヘルスケア	1.69%
金融	30.59%
情報技術	29.74%
コミュニケーション・サービス	1.90%
不動産	1.42%
合計	96.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ好配当日本株マザーファンド

### (1) 投資状況（2021年5月31日現在）

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	15,660,431,420	97.39
内 日本	15,660,431,420	97.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	420,327,970	2.61
純資産総額	16,080,759,390	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5月31日現在）

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日立	日本	株式	電気機器	88,500	5,121.00 453,208,500	5,736.00 507,636,000	3.16
2	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	51,200	8,564.00 438,476,800	9,115.00 466,688,000	2.90
3	KDDI	日本	株式	情報・通信業	113,600	3,448.00 391,692,800	3,717.00 422,251,200	2.63
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	652,100	591.60 385,782,360	620.00 404,302,000	2.51
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	101,900	3,910.00 398,429,000	3,951.00 402,606,900	2.50
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	107,900	3,715.00 400,848,500	3,719.00 401,280,100	2.50
7	東京海上HD	日本	株式	保険業	68,300	5,366.00 366,497,800	5,179.00 353,725,700	2.20

8	AGC	日本	株式	ガラス・ 土石製 品	72,600	4,905.00 356,103,000	4,780.00 347,028,000	2.16
9	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	43,200	6,956.00 300,499,200	7,626.00 329,443,200	2.05
10	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	6,700	48,940.00 327,898,000	48,660.00 326,022,000	2.03
11	富士電機	日本	株式	電気機 器	58,000	4,930.00 285,940,000	5,130.00 297,540,000	1.85
12	デクセリアルズ	日本	株式	化学	131,000	1,969.00 257,939,000	2,232.00 292,392,000	1.82
13	アドバンテスト	日本	株式	電気機 器	28,000	10,490.00 293,720,000	9,890.00 276,920,000	1.72
14	いすゞ自動車	日本	株式	輸送用 機器	178,600	1,463.11 261,313,110	1,443.00 257,719,800	1.60
15	オリックス	日本	株式	その他 金融業	132,400	1,822.50 241,299,000	1,931.50 255,730,600	1.59
16	旭化成	日本	株式	化学	200,500	1,231.00 246,815,500	1,205.00 241,602,500	1.50
17	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	81,600	2,856.00 233,049,600	2,931.50 239,210,400	1.49
18	伊藤忠	日本	株式	卸売業	71,300	3,463.00 246,911,900	3,249.00 231,653,700	1.44
19	プレミアグループ	日本	株式	その他 金融業	69,800	2,534.00 176,873,200	3,240.00 226,152,000	1.41
20	IHI	日本	株式	機械	70,800	2,218.00 157,034,400	2,662.00 188,469,600	1.17
21	三井物産	日本	株式	卸売業	77,700	2,300.00 178,710,000	2,414.00 187,567,800	1.17
22	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	24,900	7,242.00 180,325,800	7,503.00 186,824,700	1.16
23	三洋貿易	日本	株式	卸売業	146,400	1,124.00 164,553,600	1,269.00 185,781,600	1.16
24	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	81,600	2,014.00 164,342,400	2,233.00 182,212,800	1.13
25	リコー	日本	株式	電気機 器	139,900	1,189.00 166,341,100	1,298.00 181,590,200	1.13
26	MS & AD	日本	株式	保険業	54,000	3,180.00 171,720,000	3,343.00 180,522,000	1.12

27	信越化学	日本	株式	化学	9,100	18,885.00 171,853,500	18,855.00 171,580,500	1.07
28	第一工業製薬	日本	株式	化学	46,900	3,950.00 185,255,000	3,590.00 168,371,000	1.05
29	TOKAIホールディングス	日本	株式	卸売業	191,000	941.00 179,731,000	880.00 168,080,000	1.05
30	三井住友トラストHD	日本	株式	銀行業	44,200	3,768.00 166,545,600	3,771.00 166,678,200	1.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.39%
合計	97.39%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	0.34%
建設業	3.34%
食料品	1.80%
繊維製品	1.63%
化学	13.40%
医薬品	2.50%
ゴム製品	0.68%
ガラス・土石製品	3.05%
鉄鋼	0.35%
非鉄金属	2.15%
金属製品	2.15%
機械	5.67%
電気機器	12.50%
輸送用機器	6.58%
精密機器	0.75%
その他製品	2.71%
陸運業	0.99%
倉庫・運輸関連業	0.80%
情報・通信業	7.52%
卸売業	9.59%
小売業	1.06%

銀行業	6.48%
証券、商品先物取引業	0.63%
保険業	4.46%
その他金融業	3.00%
不動産業	1.16%
サービス業	2.11%
合計	97.39%

(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

## ●ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)

2021年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,713円
純資産総額	20億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.5%
3か月間	5.4%
6か月間	9.1%
1年間	15.5%
3年間	17.4%
5年間	20.6%
設定来	40.7%

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 180円 設定来分配金合計額: 3,155円

決算期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期	第84期
	19年7月	19年9月	19年11月	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
分配金	45円	45円	45円	45円	45円	45円	30円	30円	30円	30円	30円	30円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	30	68.6%	米ドル	22.4%	直接利回り(%)	日立	日本	0.3%	
国内株式	127	9.6%	ユーロ	18.6%	最終利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.3%	
外国株式	156	9.0%	日本円	15.8%	修正デュレーション	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.3%	
外国リート等	131	5.3%	豪ドル	10.7%	残存年数	KDDI	日本	0.3%	
国内リート・先物	48	4.8%	英ポンド	10.2%	債券格付別構成	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%	
			カナダドル	9.2%	AAA	75.9%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			ポーランド・ズロチ	4.8%	AA	17.2%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			デンマーク・クローネ	2.5%	A	6.9%	日本プロロジスリート	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.3%	BBB	-	野村不動産マスターF	日本	0.3%
コール・ローン、その他		2.8%	その他	4.5%	BB	-	GLP投資法人	日本	0.2%
合計	492	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.9%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

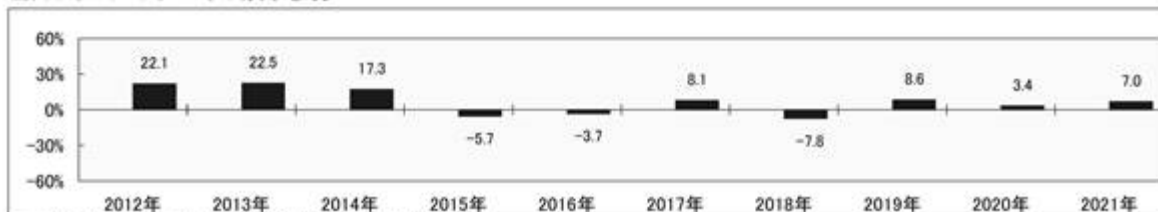
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2021年は5月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受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I C E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営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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

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



- ・ 海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
  - ・ 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

毎年1月9日から3月8日まで、3月9日から5月8日まで、5月9日から7月8日まで、7月9日から9月8日まで、9月9日から11月8日まで、および11月9日から翌年1月8日までとします。ただし、第1計算期間は、2007年6月22日から2007年7月8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、前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 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 1.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 3.または前 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ます。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年11月10日から2021年5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】

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2020年11月9日現在	当 期 2021年5月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,413,786	27,560,175
親投資信託受益証券	2,001,585,379	2,044,511,287
流動資産合計	2,029,999,165	2,072,071,462
資産合計	2,029,999,165	2,072,071,462
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,880,480	6,406,117
未払受託者報酬	190,295	194,522
未払委託者報酬	4,662,557	4,766,208
その他未払費用	86,277	84,196
流動負債合計	11,819,609	11,451,043
負債合計	11,819,609	11,451,043
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,293,493,349	1 2,135,372,570
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 275,313,793	2 74,752,151
（分配準備積立金）	51,252,112	48,445,523
元本等合計	2,018,179,556	2,060,620,419
純資産合計	2,018,179,556	2,060,620,419
負債純資産合計	2,029,999,165	2,072,071,462

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2020年5月9日 至 2020年11月9日	当 期 自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	63	3
有価証券売買等損益	161,234,806	222,925,908
<b>営業収益合計</b>	<b>161,234,869</b>	<b>222,925,911</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,208	2,041
受託者報酬	575,772	561,780
委託者報酬	<sup>1</sup> 14,107,530	<sup>1</sup> 13,764,761
その他費用	86,421	84,196
<b>営業費用合計</b>	<b>14,773,931</b>	<b>14,412,778</b>
<b>営業利益</b>	<b>146,460,938</b>	<b>208,513,133</b>
経常利益	146,460,938	208,513,133
<b>当期純利益</b>	<b>146,460,938</b>	<b>208,513,133</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,108,794	2,816,798
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	413,163,109	275,313,793
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,918,774	15,495,836
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,918,774	15,495,836
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,432,475	990,014
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,432,475	990,014
分配金	<sup>2</sup> 20,989,127	<sup>2</sup> 19,640,515
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>275,313,793</b>	<b>74,752,151</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2020年11月10日	至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日  2020年11月8日が休日のため、前特定期間末日を2020年11月9日としており、2021年5月8日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を2021年5月10日としております。このため、当特定期間は182日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首元本額	2,402,377,564円	2,293,493,349円
期中追加設定元本額	36,163,579円	12,761,643円
期中一部解約元本額	145,047,794円	170,882,422円
2. 特定期間末日における受益権の総数	2,293,493,349口	2,135,372,570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275,313,793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74,752,151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5月9日 至 2020年11月9日	自 2020年11月10日 至 2021年5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	605,835円	593,202円
2. 2 分配金の計算過程	<p>(自2020年5月9日 至2020年7月8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(7,188,919円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(19,017,194円)及び分配準備積立金(57,151,801円)より分配対象額は83,357,914円(1万口当たり352.18円)であり、うち7,100,702円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年7月9日 至2020年9月8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(6,743,049円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(19,397,545円)及び分配準備積立金(55,883,507円)より分配対象額は82,024,101円(1万口当たり351.13円)であり、うち7,007,945円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年11月10日 至2021年1月8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(6,258,433円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(18,751,569円)及び分配準備積立金(49,872,511円)より分配対象額は74,882,513円(1万口当たり335.10円)であり、うち6,703,811円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年1月9日 至2021年3月8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(6,009,784円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(18,393,537円)及び分配準備積立金(48,026,526円)より分配対象額は72,429,847円(1万口当たり332.73円)であり、うち6,530,587円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2020年9月9日 至2020年11月9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(3,656,447円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(19,179,474円)及び分配準備積立金(54,476,145円)より分配対象額は77,312,066円(1万口当たり337.09円)であり、うち6,880,480円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年3月9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(8,340,867円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(18,135,896円)及び分配準備積立金(46,510,773円)より分配対象額は72,987,536円(1万口当たり341.80円)であり、うち6,406,117円(1万口当たり30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 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 2021年5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 2020年11月9日現在	当 期 2021年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,931,892	80,049,005
合計	26,931,892	80,049,005

## (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 2020年11月9日現在	当 期 2021年5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 2020年11月10日 至 2021年5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 2020年11月9日現在	当 期 2021年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8800円 (8,800円)	0.9650円 (9,650円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ・外債ソブリン・マザーファン ド	755,860,633	1,431,600,038	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	32,615,720	103,287,462	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	62,096,019	205,407,421	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	17,282,015	67,493,181	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	34,214,037	68,780,478	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	22,722,060	67,529,962	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	29,253,531	100,412,745	
親投資信託受益証券 合計			2,044,511,287	
合計			2,044,511,287	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,336,924	113,063,265
コール・ローン	59,845,170	12,841,887
国債証券	20,009,429,764	19,689,262,627
特殊債券	993,184,336	1,009,968,505
派生商品評価勘定	16,671,416	4,658,461
未収入金	-	30,263,128
未収利息	132,062,833	100,483,090
前払費用	1,572,211	8,261,393
差入委託証拠金	122,499,944	130,218,097
流動資産合計	21,357,602,598	21,099,020,453
資産合計	21,357,602,598	21,099,020,453
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,234,913	5,152,200
未払解約金	26,242,675	30,889,380
その他未払費用	-	19
流動負債合計	52,477,588	36,041,599
負債合計	52,477,588	36,041,599
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,847,860,738
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,457,264,272	9,941,790,201
元本等合計	21,305,125,010	21,062,978,854
純資産合計	21,305,125,010	21,062,978,854
負債純資産合計	21,357,602,598	21,099,020,453

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	12,871,275,346円	11,847,860,738円
期中追加設定元本額	158,429,737円	119,048,933円
期中一部解約元本額	1,181,844,345円	845,721,018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）	1,344,677,450円	1,331,766,095円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	722,575,819円	685,361,584円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	37,705,700円	39,541,599円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	132,584,316円	131,001,808円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	244,438,546円	233,080,931円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	346,706,403円	352,142,056円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	176,525,849円	172,613,676円
6資産バランスファンド（分配型）	870,140,084円	814,575,398円
6資産バランスファンド（成長型）	97,974,458円	100,645,804円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	5,091,445,064円	4,660,059,511円

世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	52,974,306円	51,359,652円
ダイワ外債ソブリン・ファン ド(毎月分配型)	206,216,132円	181,795,213円
兵庫応援バランスファンド (毎月分配型)	748,565,093円	706,422,169円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	16,728,463円	12,545,025円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	186,763,067円	180,277,386円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	780,181,107円	755,860,633円
ダイワ海外ソブリン・ファン ド(1年決算型)	19,670,019円	20,212,976円
四国アライアンス 地域創生 ファンド(年1回決算型)	579,416,218円	536,365,891円
四国アライアンス 地域創生 ファンド(年2回決算型)	192,572,644円	155,561,246円
計	11,847,860,738円	11,121,188,653円
2. 期末日における受益権の総数	11,847,860,738口	11,121,188,653口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5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	38,131,900	13,590,850
特殊債券	3,750,321	2,540,494
合計	34,381,579	11,050,356

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年10月13日から2020年11月9日まで、及び2021年4月13日から2021年5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	2020年11月9日 現在				2021年5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	2,312,236,913	-	2,295,565,497	16,671,416	423,512,717	-	428,555,210	5,042,493
アメリカ・ドル	299,200,718	-	292,631,102	6,569,616	31,652,717	-	31,543,010	109,707
カナダ・ドル	2,013,036,195	-	2,002,934,395	10,101,800	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	391,860,000	-	397,012,200	5,152,200
買 建	2,312,236,913	-	2,286,002,000	26,234,913	391,860,000	-	396,408,754	4,548,754
アメリカ・ドル	-	-	-	-	261,240,000	-	263,525,254	2,285,254
オーストラリ ア・ドル	2,013,036,195	-	1,991,210,000	21,826,195	130,620,000	-	132,883,500	2,263,500
ユーロ	299,200,718	-	294,792,000	4,408,718	-	-	-	-
合計	4,624,473,826	-	4,581,567,497	9,563,497	815,372,717	-	824,963,964	493,739

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7982円 (17,982円)	1.8940円 (18,940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	17,538,800.000	18,791,771.870	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	27,183,400.000	25,544,784.640	
	アメリカ・ドル	小計		44,336,556.510 (4,822,487,252)	
	イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,770,585.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	3,447,520.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	3,095,700.000	2,904,850.090	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	3,905,900.000	4,626,343.250	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,642,550.000	
	イギリス・ポンド	小計		17,391,848.340 (2,654,865,649)	

オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	オーストラリア・ドル 2,307,000.000	オーストラリア・ドル 2,823,606.510	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	3,329,896.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	24,659,720.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 30,813,222.510 (2,632,681,731)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	カナダ・ドル 1,500,000.000	カナダ・ドル 1,933,875.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	6,743,000.000	6,945,290.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	11,046,000.000	10,065,336.120	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 18,944,501.120 (1,699,890,086)	
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 14,243,077.400	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	14,230,000.000	15,021,472.600	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 29,264,550.000 (383,365,605)	
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 9,704,200.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	29,000,000.000	31,918,270.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 41,622,470.000 (740,463,741)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	

	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,329,200.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 21,329,200.000 (282,825,192)	
ポーランド・ズ ロチ	1.75% Poland Government Bond 20210725	21,093,000.000	21,172,098.750	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	25,000,000.000	27,448,750.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 48,620,848.750 (1,412,717,657)	
ユーロ	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	695,000.000	1,078,521.850	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	4,750,400.000	7,345,543.520	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,470,215.000	
	1% IRISH TREASURY 20260515	3,420,000.000	3,660,152.400	
	1.1% IRISH TREASURY 20290515	2,387,600.000	2,608,214.240	
	1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	9,010,000.000	9,982,449.300	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	9,136,000.000	9,973,862.560	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	1,110,000.000	1,121,410.800	
	ユーロ 小計		ユーロ 38,240,369.670 (5,059,965,714)	
国債証券 合計			19,689,262,627 [19,689,262,627]	
特殊債券	カナダ・ドル	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	2,815,000.000	2,996,398.600	
	2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,830,000.000	8,259,240.600	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 11,255,639.200	

		(1,009,968,505)
特殊債券 合計		1,009,968,505 [1,009,968,505]
合計		20,699,231,132 [20,699,231,132]

- (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 2銘柄	100%	23.3%
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	100%	12.8%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.7%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄 特殊債券 2銘柄	100%	13.1%
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%	3.6%
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 2銘柄	100%	6.8%
ユーロ	国債証券 8銘柄	100%	24.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,568,292,185	3,130,728,330
コール・ローン	685,191,397	768,896,764

投資証券	68,024,547,724	80,423,417,677
派生商品評価勘定	5,508	340
未収入金	302,168,854	183,947,147
未収配当金	158,701,620	91,325,475
流動資産合計	71,738,907,288	84,598,315,733
資産合計	71,738,907,288	84,598,315,733
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	18,473
未払金	304,538,539	168,986,683
未払解約金	168,264,000	67,531,000
その他未払費用	-	116
流動負債合計	472,802,539	236,536,272
負債合計	472,802,539	236,536,272
純資産の部		
元本等		
元本	1	29,133,081,986
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		42,133,022,763
元本等合計		71,266,104,749
純資産合計		71,266,104,749
負債純資産合計		71,738,907,288
		84,598,315,733

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	31,024,305,893円	29,133,081,986円
期中追加設定元本額	178,845,525円	61,957,625円



期中一部解約元本額	2,070,069,432円	2,555,310,136円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルR E I T・オープン(毎月分配型)	25,448,691,633円	23,207,364,697円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	28,426,536円	26,480,492円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	14,038,742円	11,516,206円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	12,577,474円	9,750,008円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	63,556,987円	52,947,867円
6資産バランスファンド(分 配型)	127,674,682円	98,526,965円
6資産バランスファンド(成 長型)	288,986,037円	259,564,523円
りそな ワールド・リート・ ファンド	1,258,913,092円	1,183,606,533円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	38,924,605円	31,563,635円
『しがぎん』S R I三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	3,026,326円	1,872,015円
常陽3分法ファンド	160,263,516円	140,845,475円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	40,408,463円	32,615,720円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	336,736,284円	321,080,548円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	409,225,642円	395,787,304円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	528,396,059円	543,889,123円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	320,757,407円	276,242,338円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り)	24,726,545円	21,072,072円

	ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	27,751,956円	25,003,954円
計		29,133,081,986円	26,639,729,475円
2.	期末日における受益権の総数	29,133,081,986口	26,639,729,475口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5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）
投資証券	461,951,831	5,874,620,458
合計	461,951,831	5,874,620,458

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年9月16日から2020年11月9日まで、及び2021年3月16日から2021年5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	2020年11月9日 現在				2021年5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	4,542,368	-	4,541,929	439	21,461,573	-	21,461,233	340
アメリカ・ドル	4,542,368	-	4,541,929	439	-	-	-	-
シンガポ ール・ドル	-	-	-	-	21,461,573	-	21,461,233	340
買 建	4,542,368	-	4,547,437	5,069	21,461,573	-	21,443,100	18,473
アメリカ・ドル	-	-	-	-	21,461,573	-	21,443,100	18,473

イギリス・ポンド	4,542,368	-	4,547,437	5,069	-	-	-	-
合計	9,084,736	-	9,089,366	5,508	42,923,146	-	42,904,333	18,133

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額	2,4462円	3,1668円
(1万口当たり純資産額)	(24,462円)	(31,668円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	161,276	20,149,823.440	
		EQUINIX INC	26,404	18,837,933.800	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	828,506	14,565,135.480	
		CYRUSONE INC	198,334	13,897,263.380	

KIMCO REALTY CORP	314,525	6,749,706.500	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	217,802	6,161,618.580	
PARK HOTELS & RESORTS INC	136,200	3,044,070.000	
INVITATION HOMES INC	212,377	7,439,566.310	
AMERICOLD REALTY TRUST	186,727	7,164,714.990	
VICI PROPERTIES INC	460,826	14,469,936.400	
APARTMENT INCOME REIT CO	132,872	5,891,544.480	
VENTAS INC	262,074	14,353,792.980	
WEYERHAEUSER CO	129,012	5,160,480.000	
VEREIT INC	332,488	15,630,260.880	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142,579	6,738,283.540	
SUN COMMUNITIES INC	96,784	16,030,333.920	
PROLOGIS INC	158,871	18,432,213.420	
SITE CENTERS CORP	137,129	2,026,766.620	
DUKE REALTY CORP	489,078	22,463,352.540	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	44,197	12,767,629.360	
WELLTOWER INC	165,703	12,378,014.100	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	543,107	18,204,946.640	
KILROY REALTY CORP	74,548	5,053,608.920	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,020	5,656,220.600	
PUBLIC STORAGE	101,985	28,277,380.950	
REGENCY CENTERS CORP	91,285	5,966,387.600	
UDR INC	383,750	17,763,787.500	
AGREE REALTY CORP	51,679	3,636,134.440	
DIGITAL REALTY TRUST INC	88,566	13,389,407.880	
EXTRA SPACE STORAGE INC	100,427	14,786,871.480	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	245,314	5,269,344.720	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 362,356,531.450 (39,413,519,925)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	7,874,355	5,795,525.280	
SEGRO PLC	1,249,686	12,640,573.890	
UNITE GROUP PLC/THE	157,178	1,844,483.830	
BRITISH LAND CO PLC	2,515,172	13,476,291.570	
DERWENT LONDON PLC	73,029	2,539,948.620	
WORKSPACE GROUP PLC	466,975	4,172,421.620	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	529,446	4,606,180.200	

	BIG YELLOW GROUP PLC	270,294	3,327,319.140	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,353,814	5,437,310.340	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,822,979	5,422,942.650	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 59,262,997.140 (9,046,496,514)	
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	5,241,331	10,744,728.550	
	DEXUS	978,169	10,036,013.940	
	MIRVAC GROUP	11,535,083	32,067,530.740	
	GOODMAN GROUP	2,108,073	40,559,324.520	
	CHARTER HALL GROUP	2,355,555	33,425,325.450	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,133,019	11,688,944.120	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 138,521,867.320 (11,835,308,344)
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384,355	16,811,687.700	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 16,811,687.700 (1,508,512,737)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	6,130,841	16,062,803.420	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	11,974,332	25,505,327.160	
	KEPPEL REIT	10,103,200	12,224,872.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,578,777	19,642,953.330	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 73,435,955.910 (6,027,623,261)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	3,823,630	8,870,821.600	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 8,870,821.600 (703,012,612)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	274,230	3,959,881.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	67,762	4,822,621.540	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	76,827	1,697,876.700	

	NSI NV	43,486	1,435,038.000	
	ICADE	111,508	7,811,135.400	
	ARGAN	37,793	3,174,612.000	
	GECINA SA	20,034	2,558,341.800	
	KLEPIERRE	794,727	17,706,517.560	
	COVIVIO	21,769	1,658,362.420	
	AEDIFICA	85,962	8,922,855.600	
	COFINIMMO	31,376	4,088,292.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	156,213	4,623,904.800	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	45,296	2,128,912.000	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	324,872	2,929,695.690	
	ユーロ 小計		ユーロ 67,518,047.510 (8,933,988,047)	
	香港・ドル LINK REIT	2,846,392	香港・ドル 210,917,647.200	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 210,917,647.200 (2,954,956,237)	
投資証券	合計		80,423,417,677 [80,423,417,677]	
合計			80,423,417,677 [80,423,417,677]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 31銘柄	100%	49.0%
イギリス・ポンド	投資証券 10銘柄	100%	11.2%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	14.7%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	7.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.9%
ユーロ	投資証券 14銘柄	100%	11.1%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	3.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5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	1,815,665,915	2,876,520,969
投資証券 2	84,180,882,030	111,373,849,950
派生商品評価勘定	-	181,972,490
未収入金	283,354,937	478,211,970
未収配当金	839,221,098	850,977,937
前払金	25,080,000	-
流動資産合計	87,144,203,980	115,761,533,316
資産合計	87,144,203,980	115,761,533,316
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,412,000	120,130
前受金	-	182,405,000
未払金	273,631,741	394,448,740
未払解約金	10,141,000	15,572,000
その他未払費用	-	1,386
流動負債合計	289,184,741	592,547,256
負債合計	289,184,741	592,547,256
純資産の部		
元本等		
元本 1	31,357,506,835	33,552,990,780
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	55,497,512,404	81,615,995,280
元本等合計	86,855,019,239	115,168,986,060
純資産合計	86,855,019,239	115,168,986,060



負債純資産合計	87,144,203,980	115,761,533,316
---------	----------------	-----------------

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	32,425,233,799円	31,357,506,835円
期中追加設定元本額	1,168,246,539円	3,820,738,140円
期中一部解約元本額	2,235,973,503円	1,625,254,195円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワ・J-REITファンド ( FOFs用 ) ( 適格機関投資家 専用 )	28,575,786,364円	30,843,180,147円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	12,369,107円	10,179,969円
インカム重視ポートフォリオ ( 奇数月分配型 )	11,470,854円	8,875,118円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	55,617,947円	48,070,130円
6資産バランスファンド(分 配型)	115,286,250円	88,456,510円
6資産バランスファンド(成 長型)	259,748,593円	234,873,769円
世界6資産均等分散ファンド ( 毎月分配型 )	34,855,957円	28,515,570円
『しがぎん』S R I三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	1,348,135円	855,105円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	36,220,996円	29,253,531円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	302,761,433円	288,467,556円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	368,845,154円	353,962,639円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	476,369,186円	487,789,845円
D CダイワJ - R E I Tアク ティブファンド	329,517,980円	331,957,138円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(成長 型)	77,344,985円	72,482,840円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(安定 型)	26,056,410円	22,402,775円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	120,542,046円	106,152,216円
ダイワ・アクティブJリー ト・ファンド(年4回決算 型)	553,365,438円	597,515,922円
計	31,357,506,835円	33,552,990,780円

2.	期末日における受益権の総数	31,357,506,835口	33,552,990,780口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 911,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,169,700,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年11月9日現在	2021年5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）
投資証券	1,014,600,085	15,430,819,286
合計	1,014,600,085	15,430,819,286

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年5月12日から2020年11月9日まで、及び2020年11月11日から2021年5月10日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2020年11月9日 現在				2021年5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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	2,049,480,000	-	2,044,200,000	5,280,000	2,124,472,000	-	2,306,448,000	181,976,000
合計	2,049,480,000	-	2,044,200,000	5,280,000	2,124,472,000	-	2,306,448,000	181,976,000

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額	2,7698円	3,4325円
(1万口当たり純資産額)	(27,698円)	(34,325円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	4,459	584,129,000	
	サンケイリアルエステート	5,461	659,688,800	
	SOSILA物流リート投	3,035	437,647,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,160	2,674,880,000	
	森ヒルズリート	20,488	3,220,713,600	
	産業ファンド	15,444	3,051,734,400	
	アドバンス・レジデンス	13,944	4,922,232,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12,990	2,874,687,000	
	A P I 投資法人	4,801	2,390,898,000	
	G L P 投資法人	30,657	5,496,800,100	
	コンフォリア・レジデンシャル	2,751	962,850,000	
	日本プロロジスリート	18,842	6,557,016,000	
	イオンリート投資	14,041	2,110,362,300	
	ヒューリックリート投資法	13,121	2,265,996,700	
	日本リート投資法人	5,334	2,280,285,000	
	積水ハウス・リート投資	25,002	2,240,179,200	
	ケネディクス商業リート	5,764	1,589,711,200	
	ヘルスケア&メディカル投資	4,341	606,437,700	
	野村不動産マスターF	36,854	6,324,146,400	

ラサールロジポート投資	14,976	2,616,307,200	
スターアジア不動産投	15,465	869,133,000	
三井不ロジパーク	3,575	1,984,125,000	
大江戸温泉リート	435	36,105,000	
森トラスト・ホテルリート投	1,620	214,812,000	
三菱地所物流REIT	5,786	2,621,058,000	
CREロジスティクスファンド	5,300	939,160,000	
ザイマックス・リート	8,296	955,699,200	
日本ビルファンド	11,867	8,318,767,000	
ジャパンリアルエステイト	12,386	8,410,094,000	
日本都市ファンド投資法人	43,650	4,836,420,000	
オリックス不動産投資	19,856	3,806,395,200	
日本プライムリアルティ	3,778	1,628,318,000	
東急リアル・エステート	9,769	1,802,380,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	5,554	692,583,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	18,660	3,071,436,000	
森トラスト総合リート	1,565	244,140,000	
インヴィンシブル投資法人	39,427	1,677,618,850	
フロンティア不動産投資	2,050	985,025,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,674	524,799,000	
福岡リート投資法人	2,721	480,528,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,609	2,066,328,000	
大和証券オフィス投資法人	2,080	1,618,240,000	
阪急阪神リート投資法人	7,840	1,210,496,000	
スターツプロシード投資法人	667	149,341,300	
大和ハウスリート投資法人	17,953	5,358,970,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	19,614	1,267,064,400	
ジャパンエクセレント投資法人	11,450	1,738,110,000	
投資証券 合計		111,373,849,950	
合計		111,373,849,950	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド

700口

ジャパンリアルエステイト

1,000口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	48,831,636	72,277,932
コール・ローン	35,420,323	2,298,235
株式	2,296,286,744	2,986,965,744
ハイブリッド優先証券	503,080,648	500,345,277
投資証券	23,502,684	22,938,913
派生商品評価勘定	-	110,700
未収入金	21,361,013	15,391,895
未収配当金	3,629,660	2,728,341
未収利息	917,077	1,082,182
流動資産合計	2,933,029,785	3,604,139,219
資産合計	2,933,029,785	3,604,139,219
負債の部		
流動負債		
未払金	4,070,081	-
未払解約金	1,000,000	6,144,000
その他未払費用	-	25
流動負債合計	5,070,081	6,144,025
負債合計	5,070,081	6,144,025
純資産の部		
元本等		
元本	1 950,020,433	921,277,703
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,977,939,271	2,676,717,491
元本等合計	2,927,959,704	3,597,995,194
純資産合計	2,927,959,704	3,597,995,194
負債純資産合計	2,933,029,785	3,604,139,219

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	928,252,313円	950,020,433円
期中追加設定元本額	71,379,390円	28,494,683円
期中一部解約元本額	49,611,270円	57,237,413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)	7,145,177円	6,004,965円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	6,746,181円	5,290,592円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	120,527,514円	100,250,925円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	20,976,216円	16,696,307円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	21,247,595円	17,282,015円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	134,456,161円	128,529,147円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	244,827,879円	236,889,487円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	394,093,710円	410,334,265円
計	950,020,433円	921,277,703円
2. 期末日における受益権の総数	950,020,433口	921,277,703口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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。</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	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年11月9日現在	2021年5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	2,210,722	68,553,394
ハイブリッド優先証券	2,270,792	1,379,863
投資証券	96,181	131,002
合計	156,251	70,064,259

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年10月16日から2020年11月9日まで、及び2021年4月16日から2021年5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	2020年11月9日 現在				2021年5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)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0820円 (30,820円)	3.9054円 (39,054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	118.950	292,735.950	
	ADOBE INC	1,292	488.730	631,439.160	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	793	290.550	230,406.150	
	DOLLAR TREE INC	1,099	116.250	127,758.750	
	ALBEMARLE CORP	1,635	162.720	266,047.200	
	DANAHER CORP	1,220	258.480	315,345.600	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	3,434	114.810	394,257.540	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,192	67.020	146,907.840	
	TE CONNECTIVITY LTD	983	138.000	135,654.000	
	APPLE INC	12,174	130.210	1,585,176.540	
	BOEING CO/THE	1,193	235.470	280,915.710	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,153	58.720	713,624.160	
	JPMORGAN CHASE & CO	5,810	161.240	936,804.400	
	CATERPILLAR INC	1,287	240.990	310,154.130	
	MORGAN STANLEY	4,628	87.700	405,875.600	
	BROADCOM INC	1,228	452.580	555,768.240	
	DEERE & CO	537	394.220	211,696.140	
	TELEFLEX INC	528	412.550	217,826.400	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	1,722	82.180	141,513.960	
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,947	94.800	279,375.600		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	859	278.140	238,922.260		
AMAZON.COM INC	298	3,291.610	980,899.780		

EXXON MOBIL CORP	4,366	62.430	272,569.380	
EOG RESOURCES INC	2,686	83.100	223,206.600	
NEXTERA ENERGY INC	3,078	74.530	229,403.340	
GENERAL ELECTRIC CO	16,024	13.300	213,119.200	
GENERAL MOTORS CO	5,198	58.990	306,630.020	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,126	370.890	417,622.140	
ALPHABET INC-CL A	131	2,351.930	308,102.830	
FIRSTENERGY CORP	25,377	37.520	952,145.040	
HOME DEPOT INC	1,032	339.250	350,106.000	
JOHNSON & JOHNSON	2,977	168.500	501,624.500	
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	8,362	60.540	506,235.480	
MCDONALD'S CORP	1,355	234.840	318,208.200	
FACEBOOK INC-CLASS A	2,882	319.080	919,588.560	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,084	199.070	215,791.880	
MERCK & CO. INC.	2,092	78.410	164,033.720	
NIKE INC -CL B	1,197	137.810	164,958.570	
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,443	289.810	418,195.830	
NORTHROP GRUMMAN CORP	790	370.630	292,797.700	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,221	97.410	216,347.610	
PFIZER INC	8,164	39.580	323,131.120	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,032	135.150	139,474.800	
CONOCOPHILLIPS	5,115	57.100	292,066.500	
TESLA INC	302	672.370	203,055.740	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,275	217.500	494,812.500	
ANTHEM INC	421	396.570	166,955.970	
WALT DISNEY CO/THE	1,801	184.840	332,896.840	
WASTE MANAGEMENT INC	1,614	141.380	228,187.320	
WALMART INC	852	140.200	119,450.400	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,642	488.580	802,248.360	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,367	270.070	369,185.690	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,438	232.120	798,028.560	
NVIDIA CORP	314	592.490	186,041.860	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,473	198.910	491,904.430	
TYSON FOODS INC-CL A	8,743	78.820	689,123.260	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	760	468.450	356,022.000	
MASTERCARD INC - A	2,010	375.400	754,554.000	

	BANK OF AMERICA CORP	15,477	42.180	652,819.860	
	EATON CORP PLC	2,544	147.520	375,290.880	
	ECOLAB INC	1,024	228.430	233,912.320	
	INTEL CORP	3,089	57.670	178,142.630	
	MICROSOFT CORP	5,555	252.460	1,402,415.300	
	MEDTRONIC PLC	3,178	126.700	402,652.600	
	MICRON TECHNOLOGY INC	8,018	85.980	689,387.640	
	COMCAST CORP-CLASS A	4,220	58.110	245,224.200	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 27,316,776.490 (2,971,245,778)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ENBRIDGE INC	3,643	48.090	175,191.870	
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 175,191.870 (15,719,966)	
合計				2,986,965,744 [2,986,965,744]	

## (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	132,080.250	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2,558.000	72,903.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4,550.000	116,844.000	
		ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	30,828.000	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	30,600.000	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	633.000	18,274.710	
		AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2,100.000	53,634.000	
		NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	2,303.000	64,944.600	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2,582.000	67,803.320	
		VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2,076.000	53,623.080	
SOUTHERN CO 5.25	1,961.000	52,731.290			

ENBRIDGE INC 6.375 B	497.000	13,250.020	
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2,725.000	75,073.750	
UNUM GROUP 6.25	3,350.000	90,081.500	
KKR & CO INC 6.5 B	750.000	19,297.500	
KEYCORP 5.65 F	952.000	25,761.120	
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	5,088.000	138,851.520	
NISOURCE INC 6.5 B	2,810.000	78,511.400	
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	3,975.000	110,783.250	
CMS ENERGY CORP 5.875	4,546.000	125,969.660	
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5,825.000	163,216.500	
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	1,818.000	51,502.660	
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	3,038.000	84,699.440	
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	909.000	25,388.370	
SPIRE INC 5.9 A	3,556.000	99,603.560	
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1,100.000	32,010.000	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	2,895.000	78,078.150	
TCF FINANCIAL 5.7 C*	400.000	10,800.000	
ALLSTATE CORP 5.1 H	4,375.000	119,787.500	
SEMPRA ENERGY 5.75	6,407.000	175,295.520	
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1,923.000	51,594.090	
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6,414.000	169,201.320	
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	7,734.000	207,039.180	
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3,025.000	79,315.800	
SOUTHERN CO 4.95 2020	8,035.000	216,864.650	
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	11,013.000	284,575.920	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	6,084.000	156,967.800	
FIRST HORIZON CORP 6.5	3,936.000	109,420.800	
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	1,950.000	56,179.500	
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	3,578.000	96,391.320	
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2,438.000	65,411.540	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	1,675.000	41,925.250	



		BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	1,700.000	45,305.000	
		US CELLULAR CORP 5.5	1,667.000	43,158.630	
		WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	1,228.000	32,210.440	
		FIRST HORIZON CORP 6.1 D	5,763.000	153,699.210	
		TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	3,084.000	84,964.200	
		TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	2,500.000	65,000.000	
		CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	4,396.000	113,768.480	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589.000	44,968.700	
		ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1,963.000	50,409.840	
		WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1,556.000	45,248.480	
		PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,900.000	50,103.000	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	1,593.000	45,735.030	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	2,892.000	78,344.280	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 4,600,030.130 (500,345,277)	
		ハイブリッド優先証券 合計		500,345,277 [500,345,277]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1,200	31,416.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	2,875	73,657.500	
		SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1,350	36,315.000	
		QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	32,547.500	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	1,363	36,957.740	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 210,893.740 (22,938,913)	
投資証券 合計				22,938,913 [22,938,913]	
合計				523,284,190	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 ハイブリッド 優先証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 66銘柄 ハイブリッド 優先証券 55銘柄 投資証券 5銘柄	85.0%	14.3%	0.7%	99.6%
カナダ・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	-%	0.4%

## 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。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	76,285,789	9,827,236
コール・ローン	12,800,533	7,346,015
株式	1,103,641,566	1,389,065,093
未収配当金	548,939	6,563,470
流動資産合計	1,193,276,827	1,412,801,814
資産合計	1,193,276,827	1,412,801,814
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,834,000	562,000

その他未払費用	-	11
流動負債合計	2,834,000	562,011
負債合計	2,834,000	562,011
純資産の部		
元本等		
元本	1	766,113,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		424,329,632
元本等合計		1,190,442,827
純資産合計		1,190,442,827
負債純資産合計		1,193,276,827

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	795,215,797円	766,113,195円
期中追加設定元本額	33,725,564円	22,828,119円
期中一部解約元本額	62,828,166円	86,427,618円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	14,160,532円	11,922,060円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	13,180,482円	10,373,914円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	234,746,144円	196,739,306円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	40,988,847円	32,642,504円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	41,440,051円	34,214,037円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	73,262,243円	69,200,438円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	132,710,609円	127,410,420円

DCダイワ・ワールドアセット ト（六つの羽／成長コース）	215,624,287円	220,011,017円
計	766,113,195円	702,513,696円
2. 期末日における受益権の総数	766,113,195口	702,513,696口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5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	18,015,628	12,050,173
合計	18,015,628	12,050,173

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年10月16日から2020年11月9日まで、及び2021年4月16日から2021年5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

2020年11月9日現在	2021年5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)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5539円 (15,539円)	2.0103円 (20,103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	42.730	191,814.970	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	15.790	234,386.760	
	AVIVA PLC	40,669	4.096	166,580.220	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	13.556	215,540.400	
	M&G PLC	68,765	2.175	149,563.870	
	TESCO PLC	88,445	2.275	201,212.370	
	VODAFONE GROUP PLC	135,523	1.418	192,198.710	
NATIONAL GRID PLC	17,873	9.317	166,522.740		

	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	4.512	195,838.840	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	14.302	168,205.820	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 1,881,864.700 (287,266,646)	
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	303.200	398,101.600	
	NESTLE SA-REG	5,578	109.120	608,671.360	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	903	385.700	348,287.100	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	79.490	348,881.610	
	GIVAUDAN-REG	108	3,884.000	419,472.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 2,123,413.670 (256,317,264)	
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	237.500	590,425.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 590,425.000 (7,734,567)	
ユーロ	株		ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	144.280	403,984.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	83.640	250,585.440	
	BASF SE	3,676	70.380	258,716.880	
	ALLIANZ SE-REG	1,145	214.350	245,430.750	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	248.700	308,139.300	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	16.534	349,611.430	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,823	51.000	347,973.000	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	7,785	48.070	374,224.950	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	23.055	149,995.830	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,261	152.250	344,237.250	
	KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.804	246,552.910	
	TOTAL SE	6,299	39.050	245,975.950	
	MICHELIN (CGDE)	2,155	123.700	266,573.500	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	3,417	134.960	461,158.320	
	BNP PARIBAS	3,990	54.780	218,572.200	
	CAPGEMINI SE	1,883	155.100	292,053.300	
	AXA SA	12,126	22.730	275,623.980	

	SANOFI	3,893	85.440	332,617.920	
	INTESA SANPAOLO	100,555	2.362	237,510.910	
	ENI SPA	12,935	10.320	133,489.200	
	ENEL SPA	48,153	8.268	398,129.000	
	ENAGAS SA	10,115	18.790	190,060.850	
ユーロ	小計			ユーロ 6,331,216.870 (837,746,616)	
合計				1,389,065,093 [1,389,065,093]	

## (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%	20.7%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	18.5%
スウェーデン・クローナ	株式 1銘柄	100%	0.6%
ユーロ	株式 22銘柄	100%	60.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		



預金	6,032,846	-
コール・ローン	10,882,389	14,912,191
株式	645,902,109	697,352,371
投資証券	8,421,459	-
未収入金	7,421,188	14,642,002
未収配当金	745,624	275,514
流動資産合計	679,405,615	727,182,078
資産合計	679,405,615	727,182,078
負債の部		
流動負債		
前受金	-	1,070,064
未払金	-	1,574,070
未払解約金	6,095,000	8,159,000
その他未払費用	-	3
流動負債合計	6,095,000	10,803,137
負債合計	6,095,000	10,803,137
純資産の部		
元本等		
元本	1	306,612,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		366,698,538
元本等合計		673,310,615
純資産合計		673,310,615
負債純資産合計		679,405,615

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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)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>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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	357,405,036円	306,612,077円
期中追加設定元本額	928,951円	3,244,108円
期中一部解約元本額	51,721,910円	68,811,835円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	10,125,308円	7,871,791円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	9,456,274円	6,771,731円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	172,123,733円	129,233,822円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	29,762,546円	22,011,268円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	30,418,866円	22,722,060円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	9,609,303円	8,682,376円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	17,222,460円	16,088,006円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	27,893,587円	27,663,296円
計	306,612,077円	241,044,350円
2. 期末日における受益権の総数	306,612,077口	241,044,350口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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

2020年11月9日現在	2021年5月10日現在

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	4,948,994	4,782,172
投資証券	188,476	-
合計	5,137,470	4,782,172

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年10月16日から2020年11月9日まで、及び2021年4月16日から2021年5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

2020年11月9日現在	2021年5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)

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1960円 (21,960円)	2.9720円 (29,720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	8,800	50.090	440,792.000	
	SOUTH32 LTD	28,500	3.000	85,500.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,700	23.260	39,542.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,200	22.970	96,474.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	10,400	26.780	278,512.000	
	WESTPAC BANKING CORP	10,300	26.090	268,727.000	
	RIO TINTO LTD	700	127.110	88,977.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,050	93.920	286,456.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,000	158.450	158,450.000	
	CSL LTD	500	274.510	137,255.000	
WESFARMERS LTD	4,700	54.260	255,022.000		

	JB HI-FI LTD	1,700	46.830	79,611.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 2,215,318.000 (189,276,769)	
オフショア・人民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	260	1,903.000	494,780.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 494,780.000 (8,375,587)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,800	29.860	173,188.000	
	VENTURE CORP LTD	2,800	19.500	54,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	4.970	84,490.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 312,278.000 (25,631,778)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SK HYNIX INC	2,000	129,500.000	259,000,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	500	224,000.000	112,000,000.000	
	POSCO	330	398,000.000	131,340,000.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	300	154,500.000	46,350,000.000	
	HYUNDAI MOBIS CO LTD	230	277,500.000	63,825,000.000	
	NAVER CORP	390	361,000.000	140,790,000.000	
	LG CHEM LTD	90	919,000.000	82,710,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	3,500	58,300.000	204,050,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,900	81,900.000	565,110,000.000	
	LG ELECTRONICS INC	500	153,000.000	76,500,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	3,400	46,300.000	157,420,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	300	46,800.000	14,040,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,853,135,000.000 (181,051,290)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	3,000	66.700	200,100.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,000	118.600	711,600.000	

	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	9,000	19.220	172,980.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	12,000	20.250	243,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,400	454.400	1,544,960.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	143,000	6.250	893,750.000	
	AIA GROUP LTD	17,600	101.500	1,786,400.000	
	CHINA FEIHE LTD	23,000	21.000	483,000.000	
	SANDS CHINA LTD	20,800	34.550	718,640.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	6,000	149.300	895,800.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	18,000	12.300	221,400.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 7,871,630.000 (110,281,537)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	379.500	1,138,500.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	3,000	293.500	880,500.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	85.500	855,000.000	
	MEDIATEK INC	8,000	1,060.000	8,480,000.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	85,000	32.600	2,771,000.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	141,000	23.100	3,257,100.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	337.500	1,350,000.000	
	POYA INTERNATIONAL CO LTD	3,000	604.000	1,812,000.000	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	306.500	3,371,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	26,000	599.000	15,574,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	23,000	117.500	2,702,500.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	87,000	54.000	4,698,000.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 46,890,100.000 (182,735,410)	
合計				697,352,371 [697,352,371]	

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
オーストラリア・ドル	株式 12銘柄	100%	27.1%
オフショア・人民元	株式 1銘柄	100%	1.2%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	3.7%
韓国・ウォン	株式 12銘柄	100%	26.0%
香港・ドル	株式 11銘柄	100%	15.8%
台湾・ドル	株式 12銘柄	100%	26.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年11月9日現在	2021年5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	377,672,628	260,527,247
株式	14,567,867,970	15,788,191,810
未収入金	43,121,846	-
未収配当金	177,577,700	208,463,150
流動資産合計	15,166,240,144	16,257,182,207
資産合計	15,166,240,144	16,257,182,207
負債の部		
流動負債		
未払金	10,928,608	38,446,081
未払解約金	12,643,000	12,500,000
その他未払費用	-	154



流動負債合計		23,571,608	50,946,235
負債合計		23,571,608	50,946,235
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,742,455,990	4,899,243,243
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,400,212,546	11,306,992,729
元本等合計		15,142,668,536	16,206,235,972
純資産合計		15,142,668,536	16,206,235,972
負債純資産合計		15,166,240,144	16,257,182,207

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在
1. 1 期首	2020年5月9日	2020年11月10日
期首元本額	6,000,924,990円	5,742,455,990円
期中追加設定元本額	110,221,746円	89,718,289円
期中一部解約元本額	368,690,746円	932,931,036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)	3,864,318,765円	3,132,711,213円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	26,569,688円	24,345,037円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	26,226,959円	21,868,621円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	24,091,913円	19,344,109円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	432,822,965円	361,317,803円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	74,736,938円	58,855,460円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	76,910,507円	62,096,019円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	210,143,639円	199,577,941円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	386,030,788円	370,252,950円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	620,603,828円	648,874,090円
計	5,742,455,990円	4,899,243,243円
2. 期末日における受益権の総数	5,742,455,990口	4,899,243,243口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2020年11月10日 至 2021年5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5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	2020年11月9日現在	2021年5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	354,792,992	196,000,211
合計	354,792,992	196,000,211

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年10月16日から2020年11月9日まで、及び2021年4月16日から2021年5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

2020年11月9日現在	2021年5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）

	2020年11月9日現在	2021年5月10日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6370円 (26,370円)	3.3079円 (33,079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	
INPEX	73,600	813.00	59,836,800	
オリエンタル白石	304,500	300.00	91,350,000	
熊谷組	24,300	3,140.00	76,302,000	
五洋建設	53,200	883.00	46,975,600	
住友林業	22,600	2,450.00	55,370,000	
大和ハウス	35,000	3,421.00	119,735,000	
協和エクシオ	27,500	2,995.00	82,362,500	
日本工営	7,700	3,095.00	23,831,500	
九電工	30,400	3,810.00	115,824,000	
ブルボン	22,800	2,189.00	49,909,200	
日鉄ソリューションズ	24,100	3,325.00	80,132,500	
ディップ	33,100	3,230.00	106,913,000	
エレマテック	22,400	1,215.00	27,216,000	
パルグループHLDGS	67,300	1,592.00	107,141,600	
太陽化学	22,600	1,788.00	40,408,800	
日本たばこ産業	35,500	2,147.50	76,236,250	
アルコニックス	65,000	1,649.00	107,185,000	
あいホールディングス	23,300	2,242.00	52,238,600	
富士紡ホールディングス	16,700	4,540.00	75,818,000	
ダイワボウHD	66,000	1,815.00	119,790,000	
レスターホールディングス	11,500	2,037.00	23,425,500	
TOKAIホールディングス	191,000	916.00	174,956,000	
三洋貿易	146,400	1,120.00	163,968,000	
旭化成	200,500	1,207.50	242,103,750	
川田テクノロジーズ	13,100	4,375.00	57,312,500	
信和	46,200	806.00	37,237,200	
ハウスドゥ	48,400	1,068.00	51,691,200	
コメダホールディングス	32,200	2,052.00	66,074,400	
共和レザー	66,600	770.00	51,282,000	
セーレン	42,000	1,966.00	82,572,000	
ワコールホールディングス	25,100	2,602.00	65,310,200	

S R Aホールディングス	7,700	2,632.00	20,266,400
昭和電工	14,400	3,670.00	52,848,000
日本曹達	32,000	3,365.00	107,680,000
大阪ソーダ	21,900	2,588.00	56,677,200
信越化学	9,100	18,575.00	169,032,500
エア・ウォーター	58,600	1,930.00	113,098,000
四国化成	46,000	1,250.00	57,500,000
三菱瓦斯化学	16,200	2,615.00	42,363,000
東京応化工業	11,300	7,310.00	82,603,000
旭有機材	57,300	1,448.00	82,970,400
リケンテクノス	51,400	553.00	28,424,200
第一工業製薬	46,900	3,710.00	173,999,000
武田薬品	107,900	3,730.00	402,467,000
太陽ホールディングス	11,000	5,490.00	60,390,000
日本空調サービス	77,200	743.00	57,359,600
伊藤忠テクノソリューションズ	30,200	3,825.00	115,515,000
富士フイルムHLDGS	43,200	7,286.00	314,755,200
デクセリアルズ	131,000	2,017.00	264,227,000
TOYO TIRE	50,000	2,096.00	104,800,000
AGC	72,600	5,230.00	379,698,000
ニチアス	52,500	2,997.00	157,342,500
日本冶金工	24,600	2,494.00	61,352,400
大紀アルミニウム	52,700	1,067.00	56,230,900
三井金属	38,600	4,080.00	157,488,000
住友鉱山	8,300	5,283.00	43,848,900
住友電工	94,500	1,677.50	158,523,750
三和ホールディングス	94,700	1,426.00	135,042,200
日東精工	80,100	564.00	45,176,400
マルゼン	32,000	2,196.00	70,272,000
ファインシンター	19,300	1,750.00	33,775,000
タクマ	58,900	2,280.00	134,292,000
テクノプロ・ホールディング	3,900	8,470.00	33,033,000
ソディック	67,400	1,078.00	72,657,200
ベルシステム24HLDGS	65,700	1,694.00	111,295,800
豊田自動織機	13,600	9,020.00	122,672,000
フリー	43,700	997.00	43,568,900
サト-ホールディングス	17,600	2,775.00	48,840,000
技研製作所	20,800	4,555.00	94,744,000
クボタ	46,000	2,718.50	125,051,000
荏原実業	6,400	4,950.00	31,680,000

三精テクノロジーズ	29,400	800.00	23,520,000
キトー	58,600	1,824.00	106,886,400
日本トムソン	47,200	703.00	33,181,600
日立	88,500	5,384.00	476,484,000
富士電機	58,000	5,150.00	298,700,000
マブチモーター	10,400	4,445.00	46,228,000
愛知電機	19,600	2,805.00	54,978,000
E I Z O	13,000	4,160.00	54,080,000
T D K	11,300	14,820.00	167,466,000
アドバンテスト	28,000	10,200.00	285,600,000
デンソー	24,900	7,274.00	181,122,600
村田製作所	17,700	8,699.00	153,972,300
I H I	70,800	2,320.00	164,256,000
プレミアグループ	69,800	2,411.00	168,287,800
トヨタ自動車	51,200	8,506.00	435,507,200
ミクニ	68,400	317.00	21,682,800
本田技研	91,100	3,431.00	312,564,100
萩原電気H L D G S	17,900	2,669.00	47,775,100
コジマ	79,600	887.00	70,605,200
アルゴグラフィックス	28,900	3,075.00	88,867,500
ダイトロン	56,000	2,043.00	114,408,000
ナカニシ	15,000	2,208.00	33,120,000
スター精密	41,700	1,692.00	70,556,400
リコー	139,900	1,232.00	172,356,800
フジシールインターナショナル	51,100	2,479.00	126,676,900
大日本印刷	66,600	2,297.00	152,980,200
藤森工業	10,400	4,210.00	43,784,000
リンテック	23,200	2,507.00	58,162,400
信越ポリマー	127,900	1,090.00	139,411,000
任天堂	1,500	62,220.00	93,330,000
伊藤忠	71,300	3,564.00	254,113,200
三井物産	77,700	2,539.50	197,319,150
東京エレクトロン	6,700	50,060.00	335,402,000
スターゼン	21,200	2,288.00	48,505,600
セイコーHD	40,200	2,107.00	84,701,400
日本ユニシス	32,400	3,560.00	115,344,000
稲畑産業	42,200	1,665.00	70,263,000
三菱UFJフィナンシャルG	652,100	607.90	396,411,590
りそなホールディングス	147,100	468.20	68,872,220
三井住友トラストHD	44,200	3,857.00	170,479,400

三井住友フィナンシャルG	101,900	3,970.00	404,543,000	
SBIホールディングス	36,900	3,030.00	111,807,000	
オリックス	132,400	1,821.00	241,100,400	
MS&AD	54,000	3,296.00	177,984,000	
第一生命HLDGS	81,600	2,056.50	167,810,400	
東京海上HD	68,300	5,472.00	373,737,600	
東京建物	83,400	1,727.00	144,031,800	
丸全昭和運輸	14,300	3,270.00	46,761,000	
センコーグループHLDGS	108,000	1,040.00	112,320,000	
三井倉庫HOLD	56,500	2,371.00	133,961,500	
日本電信電話	81,600	2,854.00	232,886,400	
KDDI	113,600	3,440.00	390,784,000	
ソフトバンク	110,800	1,449.00	160,549,200	
シーイーシー	28,400	1,394.00	39,589,600	
日本管財	10,200	2,245.00	22,899,000	
日鉄物産	28,900	4,685.00	135,396,500	
合計			15,788,191,810	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年5月31日

資産総額	2,059,220,601円
負債総額	7,098,398円
純資産総額（ - ）	2,052,122,203円
発行済数量	2,112,708,303口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9713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5月31日

資産総額	21,122,121,406円
負債総額	38,941,345円
純資産総額（ - ）	21,083,180,061円
発行済数量	11,033,364,361口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9109円

## (参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	85,530,657,593円
負債総額	441,446,165円
純資産総額（ - ）	85,089,211,428円
発行済数量	26,353,016,614口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.2288円

## (参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書



2021年5月31日

資産総額	118,234,665,606円
負債総額	1,508,881,396円
純資産総額( - )	116,725,784,210円
発行済数量	33,643,517,933口
1単位当たり純資産額( / )	3.4695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5月31日

資産総額	3,685,849,482円
負債総額	517,000円
純資産総額( - )	3,685,332,482円
発行済数量	940,195,002口
1単位当たり純資産額( / )	3.9198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5月31日

資産総額	1,416,646,119円
負債総額	1,799,000円
純資産総額( - )	1,414,847,119円
発行済数量	693,002,139口
1単位当たり純資産額( / )	2.0416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5月31日

資産総額	721,766,479円
負債総額	0円
純資産総額( - )	721,766,479円

発行済数量	243,082,818口
1単位当たり純資産額( / )	2.9692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5月31日

資産総額	16,256,572,555円
負債総額	175,813,165円
純資産総額( - )	16,080,759,390円
発行済数量	4,906,530,425口
1単位当たり純資産額( / )	3.2774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。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年5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5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	45	95,256
追加型株式投資信託	747	20,710,140
株式投資信託 合計	792	20,805,395
単位型公社債投資信託	63	187,956
追加型公社債投資信託	14	1,510,584
公社債投資信託 合計	77	1,698,540
総合計	869	22,503,935

## 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539
固定資産		
有形固定資産	1	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2 3,530	2 3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574



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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

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

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### （2）其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

### (追加情報)

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

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

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

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

（注記に関する表示方法の変更）

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

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

（貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2. 配当に関する事項

### （1）配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23日

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、



株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

前事業年度(2020年3月31日)

### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

( 2 ) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度( 2021年3月31日)

( 1 ) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

( 単位：百万円 )

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

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

( 2 ) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

( 注1 ) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

( 単位：百万円 )

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

( 有価証券関係 )

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

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

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

当事業年度(2021年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	85	55	30
(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

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

## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

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

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (2020年 3月31日)	当事業年度 (2021年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
繰延税金負債		

連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	71	453
繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2020年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2021年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

### 1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略していません。

### 2. 地域ごとの情報

#### （1）営業収益

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

#### （2）有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 -	18,700 -

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,603	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,727	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

## (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,061	長期差入保証金	1,054

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれておりません。

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

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

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

## 当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------



同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)  不動産の賃借料(注4)	14,917  527	未払手数料  長期差入保証金	3,321  1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研 ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれておりません。

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

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

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

(注5)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 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 (2020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 (2020年07月27日現在)	(注6)	
販売会社	信金中央金庫	690,998百万円	(注4)	
投資顧問会社	アムンディ・アイルランド・リミテッド	1,032,9121-0 (2019年12月末日現在)		
	コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク	527千米ドル (2019年12月末日現在)		

(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【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2020年11月24日	臨時報告書
2021年1月25日	臨時報告書
2021年2月2日	有価証券届出書、有価証券報告書
2021年3月22日	臨時報告書

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上



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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月11日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）の2020年11月10日から2021年5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、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）の2021年5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。