

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年10月2日提出
【計算期間】	第15計算期間中 (自 2020年1月11日 至 2020年7月10日 )
【ファンド名】	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)
【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。

## 1 【ファンドの運用状況】

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

## (1) 【投資状況】(2020年7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	5,088,770,482	99.11
内 日本	5,088,770,482	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	45,824,140	0.89
純資産総額	5,134,594,622	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) 【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5計算期間末 (2011年1月11日)	681,811,989	681,811,989	0.9146	0.9146
第6計算期間末 (2012年1月10日)	884,929,811	884,929,811	0.8535	0.8535
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,295,359,257	1,295,359,257	1.0521	1.0521
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,780,966,415	1,780,966,415	1.3008	1.3008
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,254,707,121	2,254,707,121	1.5471	1.5471
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,390,744,550	2,390,744,550	1.4830	1.4830
第11計算期間末 (2017年1月10日)	2,765,672,670	2,765,672,670	1.5563	1.5563
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,190,825,667	3,190,825,667	1.6400	1.6400
第13計算期間末 (2019年1月10日)	3,597,039,246	3,597,039,246	1.5715	1.5715
2019年7月末日	4,274,365,484	-	1.6876	-
8月末日	4,380,634,586	-	1.6906	-

9月末日	4,542,669,249	-	1.7228	-
10月末日	4,757,481,570	-	1.7591	-
11月末日	4,866,320,352	-	1.7634	-
12月末日	4,920,599,519	-	1.7680	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	4,925,445,452	4,925,445,452	1.7628	1.7628
2020年1月末日	5,039,868,173	-	1.7800	-
2月末日	4,878,815,660	-	1.7228	-
3月末日	4,497,192,150	-	1.5762	-
4月末日	4,608,445,493	-	1.6010	-
5月末日	4,834,031,623	-	1.6466	-
6月末日	4,954,179,248	-	1.6531	-
7月末日	5,134,594,622	-	1.6669	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2020年1月11日～ 2020年7月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	2.1
第6計算期間	6.7
第7計算期間	23.3
第8計算期間	23.6
第9計算期間	18.9
第10計算期間	4.1
第11計算期間	4.9
第12計算期間	5.4

第13計算期間	4.2
第14計算期間	12.2
2020年1月11日～ 2020年7月10日	6.2

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年7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	203,091,737,187	97.99
内 ユーロ	83,639,718,939	40.36
内 シンガポール	823,122,803	0.40
内 マレーシア	997,032,248	0.48
内 イスラエル	762,757,487	0.37
内 ノルウェー	423,094,550	0.20
内 スウェーデン	571,531,298	0.28
内 デンマーク	1,028,118,802	0.50
内 イギリス	13,529,705,940	6.53
内 ポーランド	1,235,688,517	0.60
内 カナダ	3,740,159,368	1.80
内 アメリカ	90,284,554,875	43.56
内 メキシコ	1,517,072,864	0.73
内 オーストラリア	4,539,179,496	2.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,161,249,132	2.01
純資産総額	207,252,986,319	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)	1,793,910,030	0.87
内 日本	1,793,910,030	0.87

(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。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

## (1) 投資状況 (2020年7月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	18,778,147,120	84.69
内 日本	18,778,147,120	84.69
地方債証券	1,562,805,400	7.05
内 日本	1,562,805,400	7.05
特殊債券	835,291,300	3.77
内 日本	835,291,300	3.77
社債券	831,423,300	3.75
内 日本	831,423,300	3.75
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	166,344,730	0.75
純資産総額	22,174,011,850	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。

## ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年7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	69,523,710,279	95.29
内 香港	2,029,745,758	2.78
内 シンガポール	6,059,079,083	8.30
内 イギリス	6,648,653,776	9.11
内 オランダ	302,447,971	0.41
内 ベルギー	3,057,106,879	4.19
内 フランス	3,728,677,672	5.11
内 ドイツ	812,661,920	1.11
内 カナダ	1,881,172,491	2.58
内 アメリカ	34,259,537,799	46.96
内 オーストラリア	9,787,149,690	13.41
内 ニュージーランド	957,477,240	1.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,433,687,312	4.71
純資産総額	72,957,397,591	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)	612,134,193	0.84
内 日本	612,134,193	0.84
為替予約取引(売建)	612,984,654	0.84
内 日本	612,984,654	0.84

(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。

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年7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	78,385,975,500	94.89
内 日本	78,385,975,500	94.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,223,658,860	5.11
純資産総額	82,609,634,360	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)	2,174,352,500	2.63
内 日本	2,174,352,500	2.63

(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。

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年7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	2,109,961,387	76.05

	内 カナダ	16,821,225	0.61
	内 アメリカ	2,093,140,162	75.44
ハイブリッド優先証券		535,012,245	19.28
	内 アメリカ	535,012,245	19.28
投資証券		28,915,243	1.04
	内 アメリカ	28,915,243	1.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		100,714,472	3.63
純資産総額		2,774,603,347	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。

### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2020年7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	1,163,782,570	97.52
内 イギリス	187,620,839	15.72
内 オランダ	145,622,779	12.20
内 フランス	246,456,887	20.65
内 ドイツ	207,398,171	17.38
内 スイス	251,278,691	21.06
内 スペイン	26,894,415	2.25
内 イタリア	85,627,164	7.18
内 フィンランド	12,883,624	1.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29,573,892	2.48
純資産総額	1,193,356,462	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。

### 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 (2020年7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	674,906,415	94.85

	内 韓国	158,683,536	22.30
	内 中国	126,126,061	17.73
	内 台湾	151,186,792	21.25
	内 香港	53,039,745	7.45
	内 シンガポール	26,026,791	3.66
	内 オーストラリア	159,843,490	22.46
投資証券		7,307,649	1.03
	内 オーストラリア	7,307,649	1.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		29,354,026	4.13
純資産総額		711,568,090	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。

### ダイワ好配当日本株マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2020年7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	13,443,849,270	95.31
内 日本	13,443,849,270	95.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	662,025,557	4.69
純資産総額	14,105,874,827	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。

#### (参考情報) 運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)

2020年7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	16,669円
純資産総額	51億円



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期
	09年1月	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	277	24.6%	日本円	50.3%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.3%	
外国債券	801	24.2%	米ドル	25.6%	最終利回り(%)	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.3%	
外国リート等	132	16.0%	ユーロ	13.3%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.3%	
国内リート・先物	45	14.6%	英ポンド	3.4%	残存年数	武田薬品	日本	0.3%	
国内株式	150	8.9%	豪ドル	2.8%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.3%	
外国株式	157	8.2%	シンガポール・ドル	1.4%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.1%
			カナダドル	1.0%	AA	6.6%	野村不動産マスターF	日本	1.0%
			香港ドル	0.5%	A	6.8%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.5%	BBB	-	日本プロジスリート	日本	0.9%
コール・ローン、その他		3.8%	その他	1.2%	BB以下・無格付	2.1%	日本ビルファンド	日本	0.9%
合計	1,562	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.1%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

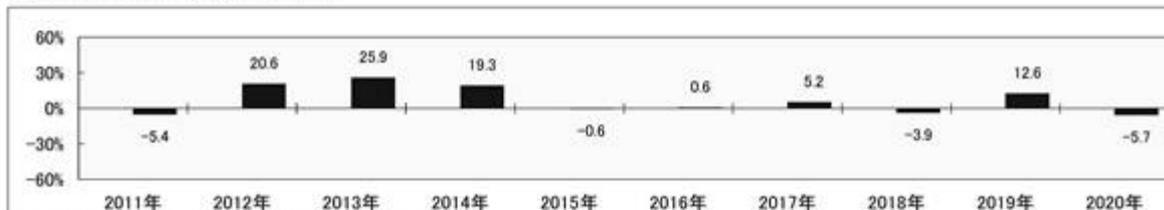
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2020年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

## (1) 【投資状況】(2020年7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	5,702,174,209	99.11
内 日本	5,702,174,209	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	51,438,230	0.89
純資産総額	5,753,612,439	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) 【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5計算期間末 (2011年1月11日)	749,069,355	749,069,355	0.8818	0.8818
第6計算期間末 (2012年1月10日)	860,992,412	860,992,412	0.8062	0.8062
第7計算期間末 (2013年1月10日)	1,272,367,641	1,272,367,641	1.0192	1.0192
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,919,665,131	1,919,665,131	1.3193	1.3193
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,724,473,332	2,724,473,332	1.5976	1.5976
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,855,754,201	2,855,754,201	1.5254	1.5254
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,346,909,631	3,346,909,631	1.6276	1.6276
第12計算期間末 (2018年1月10日)	3,894,605,094	3,894,605,094	1.7554	1.7554
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,290,592,214	4,290,592,214	1.6467	1.6467
2019年7月末日	5,050,970,381	-	1.7825	-
8月末日	5,093,725,906	-	1.7732	-
9月末日	5,271,498,276	-	1.8206	-
10月末日	5,495,588,199	-	1.8712	-
11月末日	5,608,427,295	-	1.8818	-
12月末日	5,765,803,343	-	1.8933	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	5,783,441,903	5,783,441,903	1.8888	1.8888
2020年1月末日	5,901,012,193	-	1.9013	-

2月末日	5,654,809,578	-	1.8102	-
3月末日	5,031,708,904	-	1.6156	-
4月末日	5,182,427,456	-	1.6541	-
5月末日	5,434,274,627	-	1.7102	-
6月末日	5,602,022,640	-	1.7162	-
7月末日	5,753,612,439	-	1.7277	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2020年1月11日 ~ 2020年7月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	3.7
第6計算期間	8.6
第7計算期間	26.4
第8計算期間	29.4
第9計算期間	21.1
第10計算期間	4.5
第11計算期間	6.7
第12計算期間	7.9
第13計算期間	6.2
第14計算期間	14.7
2020年1月11日 ~ 2020年7月10日	9.1

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

## ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

## (参考情報) 運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

2020年7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



## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円											
	第3期 09年1月	第4期 10年1月	第5期 11年1月	第6期 12年1月	第7期 13年1月	第8期 14年1月	第9期 15年1月	第10期 16年1月	第11期 17年1月	第12期 18年1月	第13期 19年1月	第14期 20年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国リート等	132	18.8%	日本円	50.2%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.6%	
国内債券	277	16.5%	米ドル	27.7%	最終利回り(%)	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.5%	
外国債券	801	16.3%	ユーロ	11.0%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.5%	
国内リート・先物	45	16.1%	英ポンド	3.2%	残存年数	武田薬品	日本	0.5%	
国内株式	150	15.0%	豪ドル	2.9%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.4%	
外国株式	157	13.4%	シンガポール・ドル	1.6%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.2%
			カナダ・ドル	1.0%	AA	6.6%	野村不動産マスターF	日本	1.1%
			スイス・フラン	0.7%	A	6.8%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.0%
			香港ドル	0.6%	BBB	-	日本プロロジスリート	日本	1.0%
コール・ローン、その他		4.3%	その他	1.1%	BB以下・無格付	2.1%	日本ビルファンド	日本	1.0%
合計	1,562	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.6%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

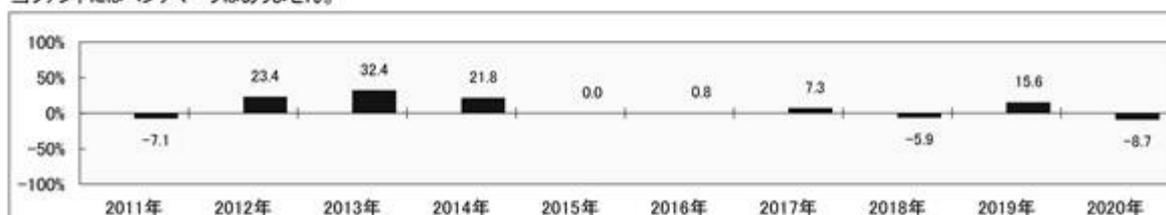
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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。

※2020年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)】

## (1) 【投資状況】(2020年7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	6,027,644,759	99.10
内 日本	6,027,644,759	99.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	54,543,392	0.90
純資産総額	6,082,188,151	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) 【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5計算期間末 (2011年1月11日)	539,491,762	539,491,762	0.8234	0.8234
第6計算期間末 (2012年1月10日)	636,326,055	636,326,055	0.7304	0.7304
第7計算期間末 (2013年1月10日)	997,507,134	997,507,134	0.9581	0.9581
第8計算期間末 (2014年1月10日)	1,528,562,866	1,528,562,866	1.3144	1.3144
第9計算期間末 (2015年1月13日)	2,263,159,704	2,263,159,704	1.6365	1.6365
第10計算期間末 (2016年1月12日)	2,808,604,084	2,808,604,084	1.5507	1.5507
第11計算期間末 (2017年1月10日)	3,374,507,781	3,374,507,781	1.6937	1.6937
第12計算期間末 (2018年1月10日)	4,081,764,824	4,081,764,824	1.8809	1.8809
第13計算期間末 (2019年1月10日)	4,424,588,740	4,424,588,740	1.7206	1.7206
2019年7月末日	5,516,202,029	-	1.8872	-
8月末日	5,522,799,007	-	1.8613	-
9月末日	5,739,816,004	-	1.9312	-
10月末日	6,068,561,360	-	2.0025	-

11月末日	6,197,782,097	-	2.0214	-
12月末日	6,304,804,389	-	2.0420	-
第14計算期間末 (2020年1月10日)	6,327,397,527	6,327,397,527	2.0384	2.0384
2020年1月末日	6,403,911,701	-	2.0451	-
2月末日	5,947,635,504	-	1.9029	-
3月末日	5,091,742,958	-	1.6374	-
4月末日	5,366,499,086	-	1.7002	-
5月末日	5,854,156,366	-	1.7768	-
6月末日	5,993,520,620	-	1.7822	-
7月末日	6,082,188,151	-	1.7918	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2020年1月11日～ 2020年7月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	6.1
第6計算期間	11.3
第7計算期間	31.2
第8計算期間	37.2
第9計算期間	24.5
第10計算期間	5.2
第11計算期間	9.2
第12計算期間	11.1
第13計算期間	8.5
第14計算期間	18.5

2020年1月11日～ 2020年7月10日	12.6
---------------------------	------

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

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

ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)」の記載と同じ。

(参考情報)運用実績

## ●DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

2020年7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	17,918円
純資産総額	60億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	5.4%
6カ月間	-12.4%
1年間	-5.1%
3年間	3.8%
5年間	5.0%
設定来	79.2%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期
	09年1月	10年1月	11年1月	12年1月	13年1月	14年1月	15年1月	16年1月	17年1月	18年1月	19年1月	20年1月
分配金	0円											

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国リート等	132	23.4%	日本円	50.0%	直接利回り(%)	APPLE INC	アメリカ	0.9%	
国内株式	150	22.6%	米ドル	30.3%	最終利回り(%)	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.8%	
外国株式	157	20.3%	ユーロ	7.7%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%	
国内リート・先物	45	19.4%	豪ドル	3.2%	残存年数	武田薬品	日本	0.7%	
国内債券	277	5.0%	英ポンド	3.1%	債券格付別構成	日本電信電話	日本	0.7%	
外国債券	801	4.9%	シンガポール・ドル	1.8%	AAA	84.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.4%
			スイス・フラン	1.1%	AA	6.6%	野村不動産マスターF	日本	1.3%
			カナダ・ドル	1.0%	A	6.8%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.2%
			香港ドル	0.8%	BBB	-	日本プロジスリート	日本	1.2%
コール・ローン、その他		5.0%	その他	1.0%	BB以下・無格付	2.1%	日本ビルファンド	日本	1.2%
合計	1,562	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.9%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

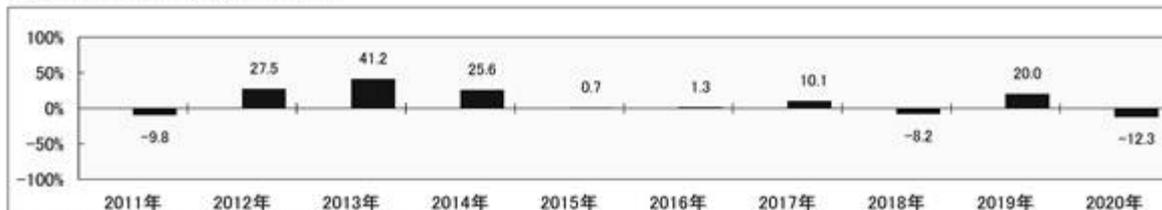
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2020年は7月31日までの騰落率を表しています。

## 2 【設定及び解約の実績】

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5計算期間	257,592,997	39,972,380
第6計算期間	379,299,436	87,980,745
第7計算期間	309,871,850	115,412,495
第8計算期間	351,397,372	213,512,755
第9計算期間	438,028,259	349,751,949
第10計算期間	345,342,005	190,621,495
第11計算期間	389,459,803	224,474,896
第12計算期間	458,208,043	289,727,307
第13計算期間	575,990,631	232,603,369
第14計算期間	809,239,523	304,172,889
2020年1月11日～ 2020年7月10日	488,872,306	260,516,893

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5計算期間	242,895,054	63,170,502
第6計算期間	330,374,277	111,886,717
第7計算期間	315,959,783	135,527,444
第8計算期間	518,832,342	312,242,524
第9計算期間	501,213,562	250,896,906
第10計算期間	501,645,807	334,815,579
第11計算期間	489,108,988	304,974,316
第12計算期間	577,484,738	415,195,786
第13計算期間	682,462,389	295,483,585
第14計算期間	853,612,726	397,196,903
2020年1月11日～ 2020年7月10日	549,513,954	328,724,391

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5計算期間	201,894,087	46,877,227
第6計算期間	304,734,938	88,735,227
第7計算期間	263,861,578	93,971,400

第8計算期間	359,002,036	237,170,149
第9計算期間	458,619,078	238,638,593
第10計算期間	698,613,794	270,347,551
第11計算期間	433,420,891	252,225,036
第12計算期間	541,348,837	363,638,097
第13計算期間	676,061,653	274,586,229
第14計算期間	898,116,398	365,651,278
2020年1月11日 ~ 2020年7月10日	606,215,989	332,108,065

### 3 【ファンドの経理状況】

#### 【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2020年1月11日から2020年7月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 安定コース）

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	74,937,153	73,295,285
親投資信託受益証券	4,881,516,489	4,955,016,355
未収入金	1,627,000	-
流動資産合計	4,958,080,642	5,028,311,640
資産合計	4,958,080,642	5,028,311,640
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,772,291	4,633,633
未払受託者報酬	1,259,547	1,307,459
未払委託者報酬	21,413,042	22,227,472
その他未払費用	190,310	196,188
流動負債合計	32,635,190	28,364,752
負債合計	32,635,190	28,364,752
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,794,039,123	1 3,022,394,536
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,131,406,329	1,977,552,352
（分配準備積立金）	809,610,553	739,659,343
元本等合計	4,925,445,452	4,999,946,888
純資産合計	4,925,445,452	4,999,946,888
負債純資産合計	4,958,080,642	5,028,311,640

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	147
有価証券売買等損益	296,038,656	282,189,134
営業収益合計	296,038,656	282,188,987
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,465	11,573
受託者報酬	1,050,815	1,307,459
委託者報酬	17,864,742	22,227,472
その他費用	158,070	196,288
営業費用合計	19,089,092	23,742,792
営業利益又は営業損失( )	276,949,564	305,931,779
経常利益又は経常損失( )	276,949,564	305,931,779
中間純利益又は中間純損失( )	276,949,564	305,931,779
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	11,103,866	28,867,700
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,308,066,757	2,131,406,329
剰余金増加額又は欠損金減少額	239,412,704	320,393,634
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	239,412,704	320,393,634
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,153,483	197,183,532
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,153,483	197,183,532
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,723,171,676	1,977,552,352

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,288,972,489円	2,794,039,123円
期中追加設定元本額	809,239,523円	488,872,306円
期中一部解約元本額	304,172,889円	260,516,893円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,794,039,123口	3,022,394,536口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	2,375,932円		2,935,603円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7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)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7628円 (17,628円)	1.6543円 (16,543円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	979,808,502	609,352,933
コール・ローン	1,651,905,787	1,460,802,998
国債証券	189,735,396,998	194,822,592,225
派生商品評価勘定	8,389,024	1,128,222
未収利息	1,364,622,870	1,185,702,434
前払費用	49,815,516	51,753,653
流動資産合計	193,789,938,697	198,131,332,465
資産合計	193,789,938,697	198,131,332,465
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	716,267	5,251,124
未払金	715,810,978	244,230
未払解約金	49,890,878	28,798,015
その他未払費用	-	9,993
流動負債合計	766,418,123	34,303,362
負債合計	766,418,123	34,303,362
純資産の部		
元本等		
元本	1 67,069,648,143	66,341,182,804
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	125,953,872,431	131,755,846,299
元本等合計	193,023,520,574	198,097,029,103
純資産合計	193,023,520,574	198,097,029,103
負債純資産合計	193,789,938,697	198,131,332,465

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	61,542,450,975円	67,069,648,143円
期中追加設定元本額	9,548,012,549円	4,617,888,279円
期中一部解約元本額	4,020,815,381円	5,346,353,618円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス	650,299,726円	618,804,552円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	22,093,366円	17,690,355円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	124,735,116円	107,815,216円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	42,191,319円	29,959,316円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	428,004,948円	355,204,026円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	38,583,061円	64,617,376円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	451,731,396円	461,977,176円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,546,708,676円	1,688,791,098円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	795,050,364円	644,610,747円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,503,662円	1,098,889円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	505,722円	810,400円
iFree 外国債券イン デックス	614,937,192円	642,529,912円
iFree 8資産バランス	816,870,082円	863,248,705円
iFree 年金バランス	15,278,264円	34,445,761円
DCダイワ外国債券インデッ クス	45,822,888,977円	47,358,525,608円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	791,449,867円	780,054,510円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	416,869,610円	416,218,724円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	261,532,079円	253,912,750円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	423,869,091円	411,525,908円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	331,858,792円	314,456,314円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	108,639,633円	101,131,931円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,489,359円	9,291,289円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	20,637,601円	20,557,885円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,581,906円	4,272,292円
ダイワつみたてインデックス外国債券	77,238,656円	133,557,361円
ダイワつみたてインデックスバランス30	735,776円	2,860,779円
ダイワつみたてインデックスバランス50	61,308円	834,625円
ダイワつみたてインデックスバランス70	217,968円	761,825円
ダイワ世界バランスファンド40VA	199,765,495円	186,830,247円
ダイワ世界バランスファンド60VA	152,054,653円	134,814,018円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,894,427,212円	4,335,639,302円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	280,209,141円	260,954,914円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,395,781円	146,481,805円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	33,400,825円	30,828,500円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,683,601,854円	24,829,725円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,748,578,972円	5,774,139,933円
ダイワライフスタイル25	34,955,853円	32,478,478円
ダイワライフスタイル50	62,515,800円	59,557,213円
ダイワライフスタイル75	17,179,040円	15,063,339円

計	67,069,648,143円	66,341,182,804円
2. 期末日における受益権の総数	67,069,648,143口	66,341,182,804口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2020年7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								
買 建	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757	1,405,573,842	-	1,401,450,940	4,122,902
アメリカ・ドル	608,468,766	-	611,164,260	2,695,494	302,632,752	-	301,108,960	1,523,792
イギリス・ポンド	43,636,685	-	43,645,500	8,815	43,185,356	-	43,964,360	779,004
オーストラリア・ドル	6,864,138	-	6,759,000	105,138	25,820,276	-	25,951,640	131,364
カナダ・ドル	23,443,239	-	23,533,750	90,511	38,613,053	-	38,587,500	25,553
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	24,668,547	-	24,725,090	56,543

ノルウェー・ クローネ	42,314,983	-	42,168,600	146,383	10,936,759	-	11,098,070	161,311
ポーランド・ ズロチ	28,244,515	-	28,238,070	6,445	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	51,349,185	-	51,586,500	237,315	-	-	-	-
ユーロ	700,991,421	-	706,346,800	5,355,379	959,717,099	-	956,015,320	3,701,779
南アフリカ・ ランド	41,054,791	-	40,598,000	456,791	-	-	-	-
合計	1,546,367,723	-	1,554,040,480	7,672,757	1,405,573,842	-	1,401,450,940	4,122,902

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2.8780円	2.9860円
(1万口当たり純資産額)	(28,780円)	(29,860円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7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	64,849,132	129,360,548
国債証券	17,604,320,010	18,358,841,640
地方債証券	1,458,385,200	1,561,991,400
特殊債券	729,970,300	835,155,400
社債券	935,292,900	831,719,500
未収利息	34,898,734	34,647,198
前払費用	1,287,679	1,347,597
流動資産合計	20,829,003,955	21,753,063,283
資産合計	20,829,003,955	21,753,063,283
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,121,900	989,873
その他未払費用	-	690
流動負債合計	6,121,900	990,563
負債合計	6,121,900	990,563
純資産の部		
元本等		
元本	1 16,028,287,542	16,836,612,468
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,794,594,513	4,915,460,252
元本等合計	20,822,882,055	21,752,072,720
純資産合計	20,822,882,055	21,752,072,720
負債純資産合計	20,829,003,955	21,753,063,283

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	13,344,778,620円	16,028,287,542円
期中追加設定元本額	3,594,110,341円	2,731,954,264円
期中一部解約元本額	910,601,419円	1,923,629,338円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	143,275,232円	245,026,825円
D C ダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,116,709円	1,871,097円
i F r e e 日本債券イン デックス	136,404,966円	133,972,097円
i F r e e 8 資産バランス	1,806,325,099円	1,985,696,147円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	6,367,336,202円	6,625,894,696円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,685,725,233円	3,796,653,291円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,155,900,772円	1,167,940,280円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	937,929,543円	941,625,664円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6 分散コー ス）	732,725,273円	726,280,361円
D C ダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	240,167,951円	232,274,739円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	52,496,870円	52,494,126円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	62,292,873円	67,788,967円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	9,940,560円	12,911,907円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	169,662,829円	314,832,790円
ダイワつみたてインデックス バランス30	5,962,153円	24,079,301円
ダイワつみたてインデックス バランス50	541,071円	7,662,857円
ダイワつみたてインデックス バランス70	957,554円	3,503,700円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	316,908,449円	308,881,337円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	202,618,203円	187,222,286円
計	16,028,287,542円	16,836,612,468円
2. 期末日における受益権の総数	16,028,287,542口	16,836,612,468口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2020年7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1月10日現在	2020年7月10日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2991円 (12,991円)	1.2920円 (12,920円)
---------------------------	----------------------	----------------------

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,087,698,334	2,692,423,348
コール・ローン	476,910,969	148,627,464
投資証券	89,388,682,897	67,765,323,940
派生商品評価勘定	-	20,385
未収入金	1,037,881,420	3,507,291
未収配当金	287,547,853	349,482,802
流動資産合計	92,278,721,473	70,959,385,230
資産合計	92,278,721,473	70,959,385,230
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	689,728	544,671
未払金	351,405,923	248,586,801
未払解約金	224,078,000	4,207,000
その他未払費用	-	7,842
流動負債合計	576,173,651	253,346,314
負債合計	576,173,651	253,346,314
純資産の部		
元本等		
元本	1 33,163,733,156	30,422,063,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	58,538,814,666	40,283,975,070
元本等合計	91,702,547,822	70,706,038,916
純資産合計	91,702,547,822	70,706,038,916
負債純資産合計	92,278,721,473	70,959,385,230

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7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。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	40,758,891,506円	33,163,733,156円
期中追加設定元本額	201,703,741円	428,134,712円
期中一部解約元本額	7,796,862,091円	3,169,804,022円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)	29,514,785,392円	26,623,881,687円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	27,600,624円	27,500,209円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	14,473,027円	14,839,071円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	12,969,327円	13,399,277円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	66,444,416円	63,552,840円
6資産バランスファンド(分配型)	121,337,152円	139,114,507円
6資産バランスファンド(成長型)	290,956,882円	308,736,829円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,382,735,184円	1,300,522,721円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	38,159,377円	44,093,069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)	3,382,852円	3,765,037円
常陽3分法ファンド	168,809,724円	169,069,564円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	39,619,502円	43,606,975円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	265,291,377円	321,133,866円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	345,957,189円	397,500,646円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	454,017,584円	515,031,398円
ダイワ・グローバルR E I T ファンド(ダイワS M A専 用)	19,380,214円	10,365,607円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	349,465,022円	372,213,951円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(部分為替ヘッジあ り)	21,643,551円	24,000,005円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	26,704,760円	29,736,587円
計	33,163,733,156円	30,422,063,846円
2. 期末日における受益権の総数	33,163,733,156口	30,422,063,846口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2020年7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	370,612,279	-	371,272,279	660,000	556,282,193	-	556,674,698	392,505
アメリカ・ドル	218,420,000	-	219,080,000	660,000	552,767,503	-	553,167,864	400,361
シンガポール・ドル	-	-	-	-	3,514,690	-	3,506,834	7,856
ユーロ	152,192,279	-	152,192,279	0	-	-	-	-
買 建	152,192,279	-	152,162,551	29,728	128,214,193	-	128,082,412	131,781
アメリカ・ドル	152,192,279	-	152,162,551	29,728	3,514,690	-	3,508,092	6,598
ユーロ	-	-	-	-	56,879,096	-	56,769,739	109,357
香港・ドル	-	-	-	-	67,820,407	-	67,804,581	15,826
合計	522,804,558	-	523,434,830	689,728	684,496,386	-	684,757,110	524,286

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2.7651円	2.3242円
(1万口当たり純資産額)	(27,651円)	(23,242円)

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7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	1,990,247,834	2,501,880,788
投資証券	2 111,334,726,250	78,791,185,660
未収入金	1,525,032,576	331,785,220
未収配当金	873,164,339	568,591,721
前払金	38,493,600	82,548,200
流動資産合計	115,761,664,599	82,275,991,589
資産合計	115,761,664,599	82,275,991,589
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,995,120	109,650,350
未払金	525,356,141	315,064,598
未払解約金	51,932,000	-
その他未払費用	-	6,069
流動負債合計	612,283,261	424,721,017
負債合計	612,283,261	424,721,017
純資産の部		

元本等			
元本	1	35,358,466,590	30,840,480,967
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		79,790,914,748	51,010,789,605
元本等合計		115,149,381,338	81,851,270,572
純資産合計		115,149,381,338	81,851,270,572
負債純資産合計		115,761,664,599	82,275,991,589

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首 期首元本額	2019年1月11日 40,074,865,523円	2020年1月11日 35,358,466,590円

期中追加設定元本額	4,247,554,247円	34,998,119,331円
期中一部解約元本額	8,963,953,180円	39,516,104,954円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・J-REITファンド (FOFs用)(適格機関投資家 専用)	- 円	28,070,135,574円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	12,326,378円	13,095,129円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	10,602,515円	11,456,854円
成長重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	54,126,491円	53,801,069円
6資産バランスファンド(分 配型)	101,070,889円	129,845,265円
6資産バランスファンド(成 長型)	237,160,019円	254,427,239円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	31,708,419円	34,135,415円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	1,384,668円	1,569,797円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	33,022,502円	38,741,853円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	223,340,105円	289,021,955円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	291,080,539円	349,103,808円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	380,661,232円	446,255,574円
DCダイワJ-REITアク ティブファンド	346,345,424円	340,362,434円
ダイワファンドラップ J- REITセレクト	32,902,728,027円	- 円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(成長 型)	72,408,222円	77,344,985円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(安定 型)	25,369,900円	25,693,710円

	ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)	118,696,450円	131,383,722円
	ダイワ・アクティブリリート・ファンド(年4回決算型)	516,434,810円	574,106,584円
計		35,358,466,590円	30,840,480,967円
2.	期末日における受益権の総数	35,358,466,590口	30,840,480,967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せん。 投資証券 722,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っておりません。 投資証券 549,000,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2020年1月10日 現在				2020年7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	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600	2,275,968,200	-	2,166,462,500	109,505,700
合計	2,217,561,600	-	2,182,680,000	34,881,600	2,275,968,200	-	2,166,462,500	109,505,700

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	3.2566円	2.6540円
(1万口当たり純資産額)	(32,566円)	(26,540円)

## 「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	79,742,449	95,937,927
コール・ローン	40,491,484	68,033,376
株式	2,225,803,957	2,008,139,981
ハイブリッド優先証券	516,369,020	534,990,226
投資証券	31,258,784	28,749,519
未収入金	7,026,310	29,646,083
未収配当金	3,548,576	3,151,770
未収利息	559,087	898,156
流動資産合計	2,904,799,667	2,769,547,038

資産合計		2,904,799,667	2,769,547,038
負債の部			
流動負債			
未払金		37,843,613	-
未払解約金		6,550,000	1,678,000
その他未払費用		-	6,132
流動負債合計		44,393,613	1,684,132
負債合計		44,393,613	1,684,132
純資産の部			
元本等			
元本	1	922,190,111	958,332,667
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,938,215,943	1,809,530,239
元本等合計		2,860,406,054	2,767,862,906
純資産合計		2,860,406,054	2,767,862,906
負債純資産合計		2,904,799,667	2,769,547,038

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7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。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p>

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	889,650,063円	922,190,111円
期中追加設定元本額	124,557,329円	78,450,404円
期中一部解約元本額	92,017,281円	42,307,848円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	8,728,464円	8,124,482円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	7,563,461円	7,072,574円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	140,259,669円	128,344,104円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	23,648,064円	22,261,205円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	23,593,216円	23,166,365円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	116,753,865円	130,228,120円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	227,747,249円	244,403,265円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	373,896,123円	394,732,552円
計	922,190,111円	958,332,667円
2. 期末日における受益権の総数	922,190,111口	958,332,667口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2020年7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1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1018円 (31,018円)	2.8882円 (28,882円)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	22,071,420	14,659,115
コール・ローン	5,555,987	2,523,814
株式	1,291,689,972	1,171,346,131
派生商品評価勘定	-	396
未収配当金	1,583,281	4,649,557
流動資産合計	1,320,900,660	1,193,179,013
資産合計	1,320,900,660	1,193,179,013

負債の部		
流動負債		
未払解約金	394,000	1,217,000
その他未払費用	-	5,994
流動負債合計	394,000	1,222,994
負債合計	394,000	1,222,994
純資産の部		
元本等		
元本	1	753,612,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	566,894,470	422,400,426
元本等合計	1,320,506,660	1,191,956,019
純資産合計	1,320,506,660	1,191,956,019
負債純資産合計	1,320,900,660	1,193,179,013

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	772,639,327円	753,612,190円
期中追加設定元本額	87,407,995円	72,979,946円
期中一部解約元本額	106,435,132円	57,036,543円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	15,220,471円	15,388,682円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,253,942円	13,137,322円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	245,943,189円	245,186,495円

ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	41,888,141円	42,218,104円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	41,523,055円	43,883,465円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	64,007,562円	72,090,391円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	125,547,416円	128,592,092円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	206,228,414円	209,059,042円
計	753,612,190円	769,555,593円
2. 期末日における受益権の総数	753,612,190口	769,555,593口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2020年1月10日 現在				2020年7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	-	-	-	-	13,283,996	-	13,283,600	396	
ユーロ	-	-	-	-	13,283,996	-	13,283,600	396	
合計	-	-	-	-	13,283,996	-	13,283,600	396	

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	1.7522円	1.5489円
(1万口当たり純資産額)	(17,522円)	(15,489円)

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,890,871	4,157,243
コール・ローン	3,982,785	6,743,519
株式	739,815,433	672,082,519
投資証券	7,810,464	20,524,136
未収入金	-	806,334
未収配当金	2,014,119	1,805,389
流動資産合計	772,513,672	706,119,140
資産合計	772,513,672	706,119,140
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,533,000	616,000
その他未払費用	-	5,958
流動負債合計	2,533,000	621,958
負債合計	2,533,000	621,958
純資産の部		
元本等		
元本	1 365,560,068	345,236,793
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	404,420,604	360,260,389
元本等合計	769,980,672	705,497,182
純資産合計	769,980,672	705,497,182
負債純資産合計	772,513,672	706,119,140

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7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>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	399,914,948円	365,560,068円
期中追加設定元本額	29,964,452円	11,680,046円
期中一部解約元本額	64,319,332円	32,003,321円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	12,675,264円	11,985,380円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	11,045,001円	10,408,728円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	207,648,885円	192,592,976円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	35,324,845円	34,375,673円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	35,358,128円	35,058,133円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	10,299,043円	10,653,764円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	20,069,686円	19,188,410円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	33,139,216円	30,973,729円
計	365,560,068円	345,236,793円
2. 期末日における受益権の総数	365,560,068口	345,236,793口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2020年7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1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2.1063円	2.0435円
(1万口当たり純資産額)	(21,063円)	(20,435円)

## 「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年1月10日現在	2020年7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	421,027,153	802,462,530
株式	17,061,261,230	13,694,696,680
未収入金	67,790,026	13,102,392
未収配当金	33,336,850	25,904,700
流動資産合計	17,583,415,259	14,536,166,302

資産合計	17,583,415,259	14,536,166,302
負債の部		
流動負債		
未払金	1,663,613	10,112,162
未払解約金	9,300,000	2,700,000
その他未払費用	-	969
流動負債合計	10,963,613	12,813,131
負債合計	10,963,613	12,813,131
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,085,455,292
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,486,996,354	8,599,202,229
元本等合計	17,572,451,646	14,523,353,171
純資産合計	17,572,451,646	14,523,353,171
負債純資産合計	17,583,415,259	14,536,166,302

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年1月11日 至 2020年7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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首	2019年1月11日	2020年1月11日
期首元本額	6,925,910,602円	6,085,455,292円
期中追加設定元本額	434,496,244円	252,367,670円
期中一部解約元本額	1,274,951,554円	413,672,020円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信(季節点描)	4,371,717,264円	4,067,164,408円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	26,532,128円	26,650,826円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	27,851,210円	28,960,378円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	24,665,342円	25,269,277円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	444,487,092円	454,153,776円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	75,782,733円	77,062,950円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	75,973,500円	81,500,494円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	168,401,560円	198,490,541円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	329,593,808円	372,025,835円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	540,450,655円	592,872,457円
計	6,085,455,292円	5,924,150,942円
2. 期末日における受益権の総数	6,085,455,292口	5,924,150,942口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年7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。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年1月10日現在	2020年7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1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,8876円	2,4516円
(1万口当たり純資産額)	(28,876円)	(24,516円)

【DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2020年1月11日から2020年7月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,872,196	84,559,915
親投資信託受益証券	5,731,930,567	5,584,045,138
未収入金	9,212,000	6,102,000
流動資産合計	5,827,014,763	5,674,707,053
資産合計	5,827,014,763	5,674,707,053
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,577,399	8,292,364
未払受託者報酬	1,465,395	1,488,690
未払委託者報酬	29,308,638	29,774,503
その他未払費用	221,428	223,397
流動負債合計	43,572,860	39,778,954
負債合計	43,572,860	39,778,954
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,061,995,528	1 3,282,785,091
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,721,446,375	2,352,143,008
(分配準備積立金)	1,028,078,333	925,874,996
元本等合計	5,783,441,903	5,634,928,099
純資産合計	5,783,441,903	5,634,928,099
負債純資産合計	5,827,014,763	5,674,707,053

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	179
有価証券売買等損益	391,124,198	503,761,429
営業収益合計	391,124,198	503,761,250
<b>営業費用</b>		
支払利息	19,037	13,847
受託者報酬	1,251,210	1,488,690
委託者報酬	1 25,024,840	1 29,774,503
その他費用	188,233	223,516
営業費用合計	26,483,320	31,500,556
営業利益又は営業損失( )	364,640,878	535,261,806
経常利益又は経常損失( )	364,640,878	535,261,806
中間純利益又は中間純損失( )	364,640,878	535,261,806
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	15,310,104	54,348,289
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,685,012,509	2,721,446,375
剰余金増加額又は欠損金減少額	274,701,175	401,186,638
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	274,701,175	401,186,638
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,825,642	289,576,488
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,825,642	289,576,488
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,191,218,816	2,352,143,008

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,605,579,705円	3,061,995,528円
期中追加設定元本額	853,612,726円	549,513,954円
期中一部解約元本額	397,196,903円	328,724,391円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,061,995,528口	3,282,785,091口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1 投資信託財産（親投資信託） の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	3,753,524円		4,303,920円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7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)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,888円 (18,888円)	1,7165円 (17,165円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- R E I Tアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

【DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年1月11日から2020年7月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	100,922,205	94,876,775
親投資信託受益証券	6,271,243,299	5,964,136,211
未収入金	6,870,000	483,000
流動資産合計	6,379,035,504	6,059,495,986
資産合計	6,379,035,504	6,059,495,986
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,914,310	2,912,086
未払受託者報酬	1,603,359	1,570,996
未払委託者報酬	36,878,037	36,134,280
その他未払費用	242,271	235,797
流動負債合計	51,637,977	40,853,159
負債合計	51,637,977	40,853,159
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,104,040,281	1 3,378,148,205
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,223,357,246	2,640,494,622
(分配準備積立金)	1,268,061,314	1,141,884,387
元本等合計	6,327,397,527	6,018,642,827
純資産合計	6,327,397,527	6,018,642,827
負債純資産合計	6,379,035,504	6,059,495,986

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	当中間計算期間 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	193
有価証券売買等損益	479,345,094	761,033,088
営業収益合計	479,345,094	761,032,895
<b>営業費用</b>		
支払利息	21,090	15,233
受託者報酬	1,327,923	1,570,996
委託者報酬	1 30,543,282	1 36,134,280
その他費用	199,799	235,920
営業費用合計	32,092,094	37,956,429
営業利益又は営業損失( )	447,253,000	798,989,324
経常利益又は経常損失( )	447,253,000	798,989,324
中間純利益又は中間純損失( )	447,253,000	798,989,324
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	19,267,155	81,181,505
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,853,013,579	3,223,357,246
剰余金増加額又は欠損金減少額	417,946,324	475,240,979
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	417,946,324	475,240,979
剰余金減少額又は欠損金増加額	135,493,114	340,295,784
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	135,493,114	340,295,784
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,563,452,634	2,640,494,622

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 1 期首元本額	2,571,575,161円	3,104,040,281円
期中追加設定元本額	898,116,398円	606,215,989円
期中一部解約元本額	365,651,278円	332,108,065円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,104,040,281口	3,378,148,205口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1 投資信託財産(親投資信託) の運用の指図に係る権限の全 部または一部を委託するため に要する費用	5,368,597円		6,260,596円	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7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)

	前計算期間末 2020年1月10日現在	当中間計算期間末 2020年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0384円 (20,384円)	1,7816円 (17,816円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

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

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ」- R E I Tアクティブ・マザーファンド」の状況

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

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

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

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

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

#### 4 【委託会社等の概況】

##### (1) 【資本金の額】

2020年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 【事業の内容及び営業の状況】

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。

2020年7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	52	90,060
追加型株式投資信託	705	16,230,396
株式投資信託 合計	757	16,320,457
単位型公社債投資信託	29	99,164
追加型公社債投資信託	14	1,449,037
公社債投資信託 合計	43	1,548,201
総合計	800	17,868,658

##### (3) 【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

2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

###### 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。

## 5 【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(2019年4月1日から2020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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
<b>流動資産計</b>	<b>40,882</b>	<b>36,088</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>	<b>1</b>	<b>1</b>
建物	10	7
器具備品	195	209
<b>無形固定資産</b>	<b>2,821</b>	<b>2,362</b>
ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
<b>投資その他の資産</b>	<b>12,799</b>	<b>15,844</b>
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
<b>固定資産計</b>	<b>15,827</b>	<b>18,424</b>

資産合計

56,709

54,512

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2	2
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
<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
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
評価・換算差額等合計	46	363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

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

## 注記事項

### (重要な会計方針)

#### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

##### (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### (2) その他有価証券

###### 時価のあるもの

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。

###### 時価のないもの

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 8～18年

## 器具備品

4～17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。

## (未適用の会計基準等)

## 1. 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

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「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)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)
- ・「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)

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

(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

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万円として組替えております。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

## 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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金	3,788百万円	3,397百万円

## 3 保証債務

前事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2018年4月1日至2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

当事業年度(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

#### (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。

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. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)参照のこと)。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		2,741	2,741	-
(2) 未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3) 有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
其他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1) 未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2) その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

#### (注1) 金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

###### (1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

###### (3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、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。

##### 負 債

###### (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

#### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	666	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	1,836	3,972
(3) 長期差入保証金	1,070	1,069

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

#### (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

(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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度(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、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

前事業年度(2019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	87	55	32
(2) その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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(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、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2) その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

当事業年度(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

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、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。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	171	183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

## (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	当事業年度
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

### 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174百万円、当事業年度181百万円であります。

## (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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		788
	731	
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	164	173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	85	71
繰延税金負債合計	244	230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

### 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(2019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(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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

[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子会社

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

## 当事業年度(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。

## (イ) 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

## 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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。

## 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,389.06円	1株当たり純資産額	14,732.52円
1株当たり当期純利益	4,550.81円	1株当たり当期純利益	4,050.66円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年5月22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	小倉 加奈子	印
--------------------	-------	--------	---

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（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61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（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年8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

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2020年1月11日から2020年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）の2020年7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中間計算期間（2020年1月11日から2020年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2020年8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

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)の2020年1月11日から2020年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)の2020年7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中間計算期間(2020年1月11日から2020年7月10日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年8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

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2020年1月11日から2020年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）の2020年7月10日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年1月11日から2020年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。