

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成23年8月3日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【電話番号】 03-5695-2111

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** 安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)
(総称を「ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ
(愛称：ミルフィーユ)(奇数月分配型)とします。)

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】** 継続申込期間（平成23年2月4日から平成24年2月3日まで）
各ファンドについて、3兆円を上限とし、合計で9兆円を上限と
します。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成23年2月3日付で提出した「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）（総称：ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ（愛称：ミルフィーユ）（奇数月分配型）」の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部____は訂正部分を示します。）

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

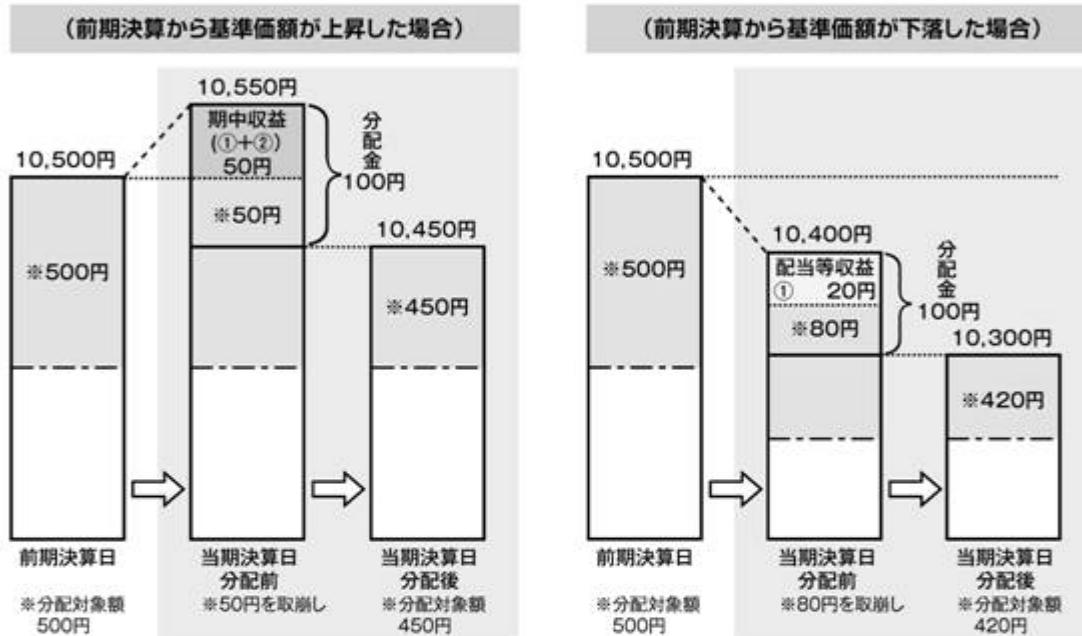
末尾に、以下を追加します。

【収益分配金に関する留意事項】

●分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



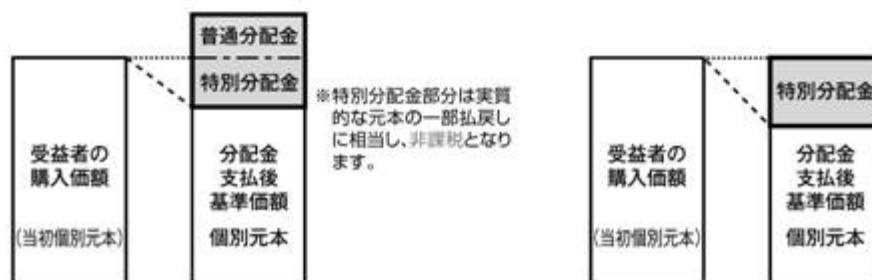
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益と②経費控除後の評価益を含む売買益 等です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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注意ください。

●受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、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。

（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(受益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。

特別分配金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の受益者の個別元本は、特別分配金の額だけ減少します。

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成22年11月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成23年5月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

< 略 >

受託会社に対する管理体制

信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で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ています。

< 略 >

上記の運用体制は平成22年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

< 略 >

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。

< 略 >

上記の運用体制は平成23年5月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

< 訂正前 >

< 略 >

< 略 >

イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

< 略 >

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%
2,500億円超の部分	年率0.30%

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 略 >

イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

< 略 >

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%

< 略 >

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

< 略 >

ただし、平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ．解約金および償還金に対する課税

< 略 >

ただし、平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。

< 略 >

法人の受益者に対する課税

法人の受益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、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日から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、特別分配金には課税されません。

< 略 >

（ ）上記は、平成22年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

< 略 >

ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ．解約金および償還金に対する課税

< 略 >

ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。

< 略 >

法人の受益者に対する課税

法人の受益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、平成25年12月31日までは7%（所得税7%）、平成26年1月1日から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、特別分配金には課税されません。

< 略 >

（ ）上記は、平成23年6月末現在のもので、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。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1) 【投資状況】（平成23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	3,290,691,372	99.31
内 日本	3,290,691,372	99.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	22,740,821	0.69
純資産総額	3,313,432,193	100.00

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	118,298,278,326	86.65
内 オーストラリア	4,308,462,468	3.16
内 カナダ	17,842,160,767	13.07
内 チェコ	1,748,008,170	1.28
内 デンマーク	2,483,536,567	1.82
内 ユーロ	30,806,930,593	22.56
内 英国	12,788,393,810	9.37
内 ノルウェー	1,316,302,425	0.96
内 ポーランド	8,260,263,577	6.05
内 スウェーデン	4,152,905,257	3.04
内 米国	34,591,314,693	25.34
特殊債券	15,476,660,569	11.34
内 オーストラリア	15,476,660,569	11.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,756,924,815	2.02
純資産総額	136,531,863,710	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（売建）	552,167,570	0.40
内 日本	552,167,570	0.40

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	124,325,904,329	99.04
内 日本	124,325,904,329	99.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,204,037,205	0.96
純資産総額	125,529,941,534	100.00

(参考)ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	566,122,027,554	97.84
内 オーストラリア	107,301,137,696	18.54
内 カナダ	14,837,725,762	2.56
内 ユーロ	65,354,624,431	11.29
内 英国	54,087,626,346	9.35
内 香港	15,039,617,004	2.60
内 シンガポール	27,808,767,181	4.81
内 米国	281,692,529,135	48.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,499,060,887	2.16
純資産総額	578,621,088,441	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)	2,288,729,518	0.40
内 日本	2,288,729,518	0.40
為替予約取引(売建)	669,334,928	0.12
内 日本	669,334,928	0.12

(参考)ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	13,540,317,250	97.54
内 日本	13,540,317,250	97.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	341,351,889	2.46
純資産総額	13,881,669,139	100.00

(参考)ダイワ北米好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,989,484,876	72.23
内 カナダ	166,794,386	6.06
内 米国	1,822,690,489	66.18
優先証券	612,025,254	22.22
内 米国	612,025,254	22.22
投資証券	60,383,801	2.19
内 米国	60,383,801	2.19

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	92,357,980	3.35
純資産総額	2,754,251,911	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（売建）	20,217,500	0.73
内 日本	20,217,500	0.73

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	2,649,752,313	97.87
内 スイス	484,950,420	17.91
内 ユーロ	1,082,607,903	39.99
内 英国	835,882,068	30.87
内 ノルウェー	31,897,320	1.18
内 スウェーデン	214,414,603	7.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	57,749,892	2.13
純資産総額	2,707,502,205	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）	7,937,069	0.29
内 日本	7,937,069	0.29
為替予約取引（売建）	21,400,853	0.79
内 日本	21,400,853	0.79

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	2,505,843,702	96.20
内 オーストラリア	995,012,846	38.20
内 香港	300,184,560	11.52
内 韓国	578,771,160	22.22
内 シンガポール	187,944,974	7.22
内 台湾	443,930,162	17.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	98,871,504	3.80
純資産総額	2,604,715,206	100.00

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	24,565,487,200	93.69
内 日本	24,565,487,200	93.69
投資証券	148,080,600	0.56

内 日本	148,080,600	0.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,505,987,943	5.74
純資産総額	26,219,555,743	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（％）
株価指数先物取引（買建）	561,675,000	2.14
内 日本	561,675,000	2.14

（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）株価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。

（注4）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】（平成23年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の詳細

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ダイワ・外債ソブリン・マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,008,335,244	1.14060 1,150,107,195	1.1606 1,170,273,884	- -	35.32%
2	ダイワ日本国債マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,048,788,133	1.11110 1,165,308,524	1.1103 1,164,469,464	- -	35.14%
3	ダイワ好配当日本株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	310,550,600	1.07360 333,407,134	1.0431 323,935,330	- -	9.78%
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 -	158,794,738	1.02510 162,780,486	1.0322 163,907,928	- -	4.95%
5	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 -	172,133,726	0.92270 158,827,790	0.9468 162,976,211	- -	4.92%
6	ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	77,879,226	1.33580 104,031,070	1.3237 103,088,731	- -	3.11%
7	ダイワ欧州好配当株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	115,427,756	0.87350 100,826,144	0.8835 101,980,422	- -	3.08%
8	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 -	109,678,179	0.91120 99,938,756	0.9123 100,059,402	- -	3.02%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.31%

合計	99.31%
----	--------

(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。

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	8,045,128,000	134.96 10,858,509,262	140.13 11,273,637,866	8.000000 21/06/07	8.26%
2	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	7,208,740,000	130.31 9,394,346,254	137.01 9,876,694,674	6.250000 30/01/04	7.23%
3	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	6,874,800,000	135.39 9,308,341,704	137.06 9,422,738,376	11.250000 15/02/15	6.90%
4	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	5,394,696,000	139.38 7,519,381,147	144.21 7,780,122,677	8.125000 21/05/15	5.70%
5	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券 -	7,215,055,000	102.42 7,389,863,928	102.69 7,409,428,582	6.250000 15/10/24	5.43%
6	EUROPEAN INVESTMENT BANK オーストラリア	特殊債券 -	6,959,200,000	95.30 6,632,535,152	98.29 6,840,336,864	6.000000 20/08/06	5.01%
7	BELGIUM GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	5,778,619,000	117.27 6,777,106,577	117.22 6,774,275,054	8.000000 15/03/28	4.96%
8	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	4,626,336,000	140.23 6,487,858,145	144.60 6,689,728,119	8.125000 21/08/15	4.90%
9	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU オーストラリア	特殊債券 -	6,524,250,000	95.75 6,247,034,618	98.69 6,438,847,568	6.000000 20/08/20	4.72%
10	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	4,883,340,000	116.91 5,709,503,461	122.22 5,968,564,648	4.750000 40/07/04	4.37%
11	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	3,117,040,000	157.90 4,921,837,330	164.40 5,124,507,271	9.000000 25/06/01	3.75%
12	ITALIAN GOVERNMENT BOND 米国	国債証券 -	4,044,000,000	112.11 4,533,849,720	118.40 4,788,096,000	6.875000 23/09/27	3.51%
13	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	2,884,920,000	150.92 4,354,094,359	157.79 4,552,317,212	8.000000 27/06/01	3.33%
14	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND オーストラリア	国債証券 -	4,132,025,000	100.79 4,164,791,958	104.27 4,308,462,468	5.750000 21/05/15	3.16%
15	SWEDISH GOVERNMENT BOND スウェーデン	国債証券 -	3,468,850,000	111.12 3,854,794,251	111.84 3,879,735,283	6.750000 14/05/05	2.84%
16	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	3,100,128,400	122.44 3,795,797,213	122.83 3,807,949,716	10.250000 14/03/15	2.79%
17	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	2,674,210,000	135.75 3,630,400,528	139.36 3,726,912,767	8.500000 19/10/25	2.73%

18	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	2,426,400,000	93.76 2,275,113,960	100.01 2,426,763,960	4.250000 40/11/15	1.78%
19	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	2,022,000,000	101.93 2,061,166,140	108.71 2,198,277,960	4.750000 41/02/15	1.61%
20	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU オーストラリア	特殊債券 -	2,174,750,000	98.20 2,135,778,480	101.04 2,197,476,138	6.250000 19/12/04	1.61%
21	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	2,092,860,000	98.95 2,071,010,542	99.13 2,074,756,761	4.250000 19/02/01	1.52%
22	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	1,202,050,000	142.56 1,713,738,644	148.03 1,779,442,697	8.000000 23/06/01	1.30%
23	Czech Republic Government Bond チェコ	国債証券 -	1,491,500,000	116.23 1,733,570,450	117.19 1,748,008,170	6.950000 16/01/26	1.28%
24	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	1,744,050,000	92.61 1,615,164,705	93.34 1,628,035,794	5.000000 40/09/01	1.19%
25	DANISH GOVERNMENT BOND デンマーク	国債証券 -	1,092,000,000	133.08 1,453,331,880	139.31 1,521,330,720	7.000000 24/11/10	1.11%
26	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	1,202,760,000	125.59 1,510,630,477	125.94 1,514,755,944	6.000000 28/12/07	1.11%
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	1,077,700,000	118.12 1,273,043,902	124.90 1,346,068,854	5.000000 37/06/01	0.99%
28	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND ノルウェー	国債証券 -	1,222,500,000	107.58 1,315,208,400	107.67 1,316,302,425	6.500000 13/05/15	0.96%
29	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	889,680,000	139.76 1,243,491,582	144.50 1,285,587,600	7.625000 25/02/15	0.94%
30	CANADIAN GOVERNMENT BOND カナダ	国債証券 -	911,900,000	106.73 973,279,989	109.84 1,001,703,912	4.250000 18/06/01	0.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	86.65%
特殊債券	11.34%
合計	97.98%

(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	英ポンド売/円買 2011年6月	売建	893,000	118,711,848	119,331,590	0.09%
		ユーロ売/円買 2011年6月	売建	3,723,000	429,015,809	432,835,980	0.32%

(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。

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位: 円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	5 6 2 0 年国債 日本	国債証券 -	6,930,000,000	106.22 7,361,126,500	107.54 7,452,522,000	2.000000 22/06/20	5.94%
2	4 8 2 0 年国債 日本	国債証券 -	6,206,000,000	111.53 6,922,035,300	112.63 6,990,128,100	2.500000 20/12/21	5.57%
3	7 0 2 0 年国債 日本	国債証券 -	5,518,000,000	109.35 6,034,043,360	110.84 6,116,592,640	2.400000 24/06/20	4.87%
4	3 8 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	5,086,000,000	112.39 5,716,358,840	113.33 5,764,421,540	2.700000 18/03/20	4.59%
5	4 3 2 0 年国債 日本	国債証券 -	4,487,000,000	114.69 5,146,356,730	115.71 5,191,952,570	2.900000 19/09/20	4.14%
6	5 4 2 0 年国債 日本	国債証券 -	4,437,000,000	108.56 4,816,894,460	109.67 4,866,057,900	2.200000 21/12/20	3.88%
7	2 9 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	4,075,000,000	116.38 4,742,566,500	116.29 4,738,817,500	4.200000 15/09/21	3.78%
8	2 7 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	4,021,000,000	115.94 4,661,987,610	115.52 4,645,380,880	5.000000 14/09/22	3.70%
9	4 2 2 0 年国債 日本	国債証券 -	4,083,000,000	111.93 4,570,316,870	113.08 4,617,138,060	2.600000 19/03/20	3.68%
10	3 3 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,819,000,000	117.14 4,473,635,880	117.33 4,481,100,030	3.800000 16/09/20	3.57%
11	1 6 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	4,378,000,000	103.32 4,523,718,500	101.99 4,465,165,980	6.800000 11/09/20	3.56%
12	2 3 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,969,000,000	113.03 4,486,215,709	112.16 4,451,828,849	5.500000 13/09/20	3.55%
13	6 4 2 0 年国債 日本	国債証券 -	4,205,000,000	104.10 4,377,615,250	105.57 4,439,554,900	1.900000 23/09/20	3.54%
14	2 2 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,875,000,000	110.15 4,268,565,000	109.17 4,230,608,750	5.300000 13/03/20	3.37%
15	1 9 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,717,000,000	108.54 4,034,720,860	107.44 3,993,730,650	5.900000 12/09/20	3.18%
16	3 4 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,254,000,000	116.42 3,788,501,320	116.86 3,802,656,940	3.500000 17/03/20	3.03%
17	2 4 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,379,000,000	113.06 3,820,558,030	112.48 3,801,003,310	4.700000 14/03/20	3.03%
18	4 0 2 0 年国債 日本	国債証券 -	3,377,000,000	110.13 3,719,187,110	110.76 3,740,500,280	2.300000 18/09/20	2.98%
19	2 8 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	3,103,000,000	117.97 3,660,850,220	117.61 3,649,469,330	5.000000 15/03/20	2.91%
20	3 2 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	2,948,000,000	115.49 3,404,891,560	115.58 3,407,504,760	3.700000 16/03/21	2.71%
21	6 3 2 0 年国債 日本	国債証券 -	3,198,000,000	103.40 3,306,985,240	104.71 3,348,817,680	1.800000 23/06/20	2.67%
22	8 3 2 0 年国債 日本	国債証券 -	3,070,000,000	104.47 3,207,431,800	106.08 3,256,901,600	2.100000 25/12/20	2.59%
23	5 2 2 0 年国債 日本	国債証券 -	2,908,000,000	107.40 3,123,279,240	108.74 3,162,420,920	2.100000 21/09/21	2.52%
24	4 4 2 0 年国債 日本	国債証券 -	2,765,000,000	111.28 3,077,140,050	112.48 3,110,320,850	2.500000 20/03/20	2.48%
25	1 8 利付国債 2 0 年 日本	国債証券 -	2,806,000,000	106.20 2,980,196,480	104.90 2,943,634,300	6.300000 12/03/20	2.34%

26	3 7 利付国債 2 0 年	日本	国債証券 -	2,178,000,000	114.65 2,497,139,580	115.34 2,512,279,440	3.100000 17/09/20	2.00%
27	8 2 2 0 年国債	日本	国債証券 -	2,095,000,000	104.71 2,193,842,100	106.31 2,227,257,350	2.100000 25/09/20	1.77%
28	8 0 2 0 年国債	日本	国債証券 -	1,683,000,000	104.95 1,766,375,820	106.52 1,792,866,240	2.100000 25/06/20	1.43%
29	4 9 2 0 年国債	日本	国債証券 -	1,158,000,000	107.52 1,245,081,600	108.75 1,259,325,000	2.100000 21/03/22	1.00%
30	7 5 2 0 年国債	日本	国債証券 -	1,100,000,000	105.77 1,163,549,000	106.67 1,173,414,000	2.100000 25/03/20	0.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.04%
合計	99.04%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 -	46,176,948	816 37,712,024,346	792 36,594,256,956	- -	6.32%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券 -	1,857,676	16,720 31,060,542,336	17,835 33,133,171,039	- -	5.73%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC 米国	投資証券 -	3,060,692	8,553 26,179,974,970	9,402 28,777,544,392	- -	4.97%
4	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	53,659,652	316 16,968,841,688	310 16,664,235,665	- -	2.88%
5	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資証券 -	61,392,398	229 14,070,113,176	231 14,205,795,707	- -	2.46%
6	EQUITY RESIDENTIAL 米国	投資証券 -	2,853,204	4,382 12,502,963,619	4,901 13,984,488,655	- -	2.42%
7	VORNADO REALTY TRUST 米国	投資証券 -	1,779,629	7,199 12,813,168,129	7,815 13,908,573,706	- -	2.40%
8	BRITISH LAND CO PLC 英国	投資証券 -	16,687,158	743 12,414,577,363	789 13,179,724,309	- -	2.28%
9	BOSTON PROPERTIES INC 米国	投資証券 -	1,457,761	7,530 10,977,388,065	8,599 12,536,701,450	- -	2.17%
10	HAMMERSON PLC 英国	投資証券 -	18,830,080	597 11,250,842,080	631 11,900,300,993	- -	2.06%

11	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	-	182,327,848	59 10,785,275,658	64 11,816,221,126	- -	2.04%
12	CORIO NV ユーロ	投資証券	-	2,152,183	5,483 11,801,456,881	5,453 11,737,240,658	- -	2.03%
13	CAPITACOMMERCIAL TRUST シンガポール	投資証券	-	121,174,000	91 11,141,364,091	95 11,609,099,305	- -	2.01%
14	HOST HOTELS&RESORTS INC 米国	投資証券	-	8,103,234	1,395 11,311,323,168	1,422 11,528,302,465	- -	1.99%
15	PUBLIC STORAGE 米国	投資証券	-	1,191,368	8,877 10,575,986,523	9,379 11,174,619,150	- -	1.93%
16	GPT GROUP オーストラリア	投資証券	-	40,773,687	262 10,711,647,157	273 11,137,275,521	- -	1.92%
17	GECINA SA ユーロ	投資証券	-	893,481	10,999 9,827,472,196	11,871 10,606,662,162	- -	1.83%
18	LINK REIT 香港	投資証券	-	38,774,824	253 9,842,960,203	270 10,504,875,318	- -	1.82%
19	LAND SECURITIES PLC 英国	投資証券	-	8,661,911	989 8,572,967,146	1,102 9,550,016,735	- -	1.65%
20	SEGRE PLC 英国	投資証券	-	20,682,018	423 8,752,407,717	427 8,847,387,577	- -	1.53%
21	UDR INC 米国	投資証券	-	4,186,029	1,895 7,935,987,638	2,070 8,667,290,253	- -	1.50%
22	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券	-	110,439,144	74 8,261,277,429	77 8,550,320,012	- -	1.48%
23	PROLOGIS 米国	投資証券	-	6,381,127	1,224 7,814,644,846	1,320 8,428,003,660	- -	1.46%
24	GENERAL GROWTH PROPERTIES 米国	投資証券	-	6,313,478	1,184 7,480,551,671	1,318 8,323,335,840	- -	1.44%
25	CAPITAMALL TRUST シンガポール	投資証券	-	60,172,392	120 7,224,162,355	128 7,739,084,232	- -	1.34%
26	VENTAS INC 米国	投資証券	-	1,503,909	4,276 6,431,546,879	4,485 6,745,941,429	- -	1.17%
27	HEALTH CARE REIT INC 米国	投資証券	-	1,434,850	4,214 6,047,400,309	4,230 6,069,449,936	- -	1.05%
28	DERWENT LONDON PLC 英国	投資証券	-	2,432,134	2,226 5,415,513,694	2,418 5,883,050,018	- -	1.02%
29	REGENCY CENTERS CORP 米国	投資証券	-	1,525,656	3,519 5,370,083,427	3,720 5,676,172,635	- -	0.98%
30	AVALONBAY COMMUNITIES INC 米国	投資証券	-	533,947	9,374 5,005,646,763	10,514 5,614,132,337	- -	0.97%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.84%
合計	97.84%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位:円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2011年6月	売建	8,276,678	669,417,694	669,334,928	0.12%
		米ドル買/円売 2011年6月	買建	20,000,000	1,617,592,000	1,617,400,000	0.28%
		シンガポールのドル買/円 売 2011年6月	買建	1,162,558	76,092,678	76,275,456	0.01%
		英債券買/円売 2011年6月	買建	4,452,998	593,325,016	595,054,062	0.10%

(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。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位:円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	日本ビルファンド 日本	投資証券 -	2,250	821,000 1,847,250,000	831,000 1,869,750,000	- -	13.47%
2	ジャパンリアルエステイト 日本	投資証券 -	1,900	799,000 1,518,100,000	794,000 1,508,600,000	- -	10.87%
3	日本リテールファンド 日本	投資証券 -	7,100	130,400 925,840,000	131,500 933,650,000	- -	6.73%
4	森トラスト総合リート 日本	投資証券 -	1,000	818,000 818,000,000	830,000 830,000,000	- -	5.98%
5	野村不動産オフィスF 日本	投資証券 -	1,300	558,000 725,400,000	567,000 737,100,000	- -	5.31%
6	アドバンス・レジデンス 日本	投資証券 -	4,200	164,600 691,320,000	167,600 703,920,000	- -	5.07%
7	フロンティア不動産投資 日本	投資証券 -	800	750,000 600,000,000	755,000 604,000,000	- -	4.35%
8	日本プライムリアルティ 日本	投資証券 -	2,500	231,700 579,250,000	235,700 589,250,000	- -	4.24%
9	ユナイテッド・アーバン投資 法人 日本	投資証券 -	6,000	103,900 623,400,000	92,700 556,200,000	- -	4.01%
10	グローバル・ワン不動産投資 法人 日本	投資証券 -	610	704,000 429,440,000	751,000 458,110,000	- -	3.30%
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 -	690	591,000 407,790,000	590,000 407,100,000	- -	2.93%
12	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券 -	1,400	281,100 393,540,000	288,500 403,900,000	- -	2.91%
13	オリックス不動産投資 日本	投資証券 -	800	424,500 339,600,000	440,000 352,000,000	- -	2.54%
14	森ヒルズリート 日本	投資証券 -	1,200	272,300 326,760,000	281,300 337,560,000	- -	2.43%
15	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券 -	400	688,000 275,200,000	734,000 293,600,000	- -	2.12%
16	ビ・ライフ投資法人 日本	投資証券 -	500	590,000 295,000,000	582,000 291,000,000	- -	2.10%

17	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券 -	850	346,500 294,525,000	334,000 283,900,000	- -	2.05%
18	野村不レジデンシャル 日本	投資証券 -	600	494,000 296,400,000	464,500 278,700,000	- -	2.01%
19	トップリート投資法人 日本	投資証券 -	550	486,000 267,300,000	483,000 265,650,000	- -	1.91%
20	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券 -	550	443,000 243,650,000	454,500 249,975,000	- -	1.80%
21	東急リアル・エステート 日本	投資証券 -	450	543,000 244,350,000	544,000 244,800,000	- -	1.76%
22	M I D リート投資法人 日本	投資証券 -	1,000	248,000 248,000,000	243,600 243,600,000	- -	1.75%
23	福岡リート投資法人 日本	投資証券 -	414	600,000 248,400,000	588,000 243,432,000	- -	1.75%
24	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券 -	4,255	35,047 149,125,222	37,950 161,477,250	- -	1.16%
25	平和不動産リート 日本	投資証券 -	3,200	53,100 169,920,000	49,300 157,760,000	- -	1.14%
26	プレミア投資法人 日本	投資証券 -	400	379,000 151,600,000	388,000 155,200,000	- -	1.12%
27	産業ファンド 日本	投資証券 -	319	427,000 136,213,000	437,000 139,403,000	- -	1.00%
28	積水ハウス・S I 投資法人 日本	投資証券 -	370	362,500 134,125,000	374,000 138,380,000	- -	1.00%
29	ジャパン・ホテル・アンド・ リゾート投資法人 日本	投資証券 -	550	183,000 100,650,000	186,000 102,300,000	- -	0.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.54%
合計	97.54%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ORACLE CORPORATION 米国	株式 サービス業	22,800	2,734 62,347,804	2,725 62,144,957	- -	2.26%

2	CHEVRON CORP	米国	株式 石油・石炭製品	7,100	8,482 60,227,130	8,347 59,268,136	- -	2.15%
3	EXXON MOBIL CORP	米国	株式 石油・石炭製品	8,000	6,748 53,989,018	6,683 53,464,915	- -	1.94%
4	JPMORGAN CHASE & CO	米国	株式 銀行業	15,100	3,637 54,921,321	3,460 52,258,914	- -	1.90%
5	GENERAL ELECTRIC CO	米国	株式 電気機器	29,900	1,617 48,366,240	1,572 47,011,985	- -	1.71%
6	QUALCOMM INC	米国	株式 電気機器	9,700	4,254 41,266,594	4,638 44,993,140	- -	1.63%
7	VISA INC-CLASS A SHS	米国	株式 その他金融業	6,600	6,171 40,734,888	6,454 42,597,878	- -	1.55%
8	CVS CAREMARK CORP	米国	株式 小売業	13,500	2,880 38,881,847	3,138 42,364,944	- -	1.54%
9	MCDONALD'S CORP	米国	株式 サービス業	5,900	6,233 36,777,187	6,601 38,948,411	- -	1.41%
10	H>MORGAN S CP TR VII 6.60	米国	優先証券 -	19,000	1,972 37,472,396	2,016 38,310,430	- -	1.39%
11	APACHE CORP	米国	株式 石油他	3,600	9,934 35,762,710	9,968 35,886,456	- -	1.30%
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	米国	株式 サービス業	9,100	3,625 32,987,879	3,906 35,549,186	- -	1.29%
13	OCCIDENTAL PETROLEUM	米国	株式 石油・石炭製品	4,100	7,889 32,348,360	8,619 35,339,465	- -	1.28%
14	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	米国	株式 保険業	6,900	4,885 33,707,549	5,109 35,253,408	- -	1.28%
15	HARRIS CORP	米国	株式 情報・通信業	8,700	4,046 35,203,910	3,959 34,450,998	- -	1.25%
16	H>CITIGROUP CAP VIII 6.95	米国	優先証券 -	16,500	2,005 33,082,751	2,041 33,683,285	- -	1.22%
17	TEXAS INSTRUMENTS INC	米国	株式 電気機器	11,200	2,807 31,442,262	2,808 31,451,320	- -	1.14%
18	PHILIP MORRIS INTERNATION	米国	株式 食料品	5,500	5,353 29,443,960	5,703 31,370,117	- -	1.14%
19	THE WALT DISNEY CO.	米国	株式 サービス業	9,300	3,333 30,998,632	3,358 31,230,680	- -	1.13%
20	AT&T INC	米国	株式 情報・通信業	12,200	2,449 29,888,233	2,530 30,874,969	- -	1.12%
21	JOHNSON CONTROLS INC	米国	株式 輸送用機器	9,400	3,152 29,635,403	3,159 29,696,224	- -	1.08%
22	ABBOTT LABS	米国	株式 医薬品	7,100	4,124 29,286,648	4,169 29,602,484	- -	1.07%
23	COVIDIEN PLC	米国	株式 その他製品	6,700	4,270 28,612,109	4,410 29,549,589	- -	1.07%
24	H>KEYCORP CAP IX	米国	優先証券 -	14,301	2,008 28,717,269	2,056 29,413,988	- -	1.07%
25	ROSS STORES INC	米国	株式 小売業	4,400	5,719 25,163,709	6,608 29,078,301	- -	1.06%
26	H>FIFTH THIRD CAP VI	米国	優先証券 -	14,028	2,047 28,716,337	2,068 29,011,329	- -	1.05%
27	CORNING INC	米国	株式 電気機器	18,000	1,586 28,563,581	1,607 28,927,541	- -	1.05%
28	COSTCO WHOLESALE CORP	米国	株式 小売業	4,100	6,171 25,301,690	6,594 27,036,000	- -	0.98%

29	SYMANTEC CORP 米国	株式 サービス業	17,200	1,490 25,638,636	1,554 26,737,634	- -	0.97%
30	MERCK & CO INC 米国	株式 医薬品	9,100	2,738 24,921,231	2,928 26,650,850	- -	0.97%

(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	72.23%
優先証券	22.22%
投資証券	2.19%
合計	96.65%

(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	0.96%
食料品	2.24%
化学	2.27%
医薬品	3.97%
石油・石炭製品	6.77%
機械	0.96%
電気機器	7.68%
輸送用機器	2.74%
その他製品	1.44%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	0.78%
海運業	0.35%
情報・通信業	3.91%
卸売業	0.42%
小売業	5.23%
銀行業	6.29%
証券・商品先物取引業	0.65%
保険業	2.08%
その他金融業	2.78%
サービス業	12.73%
石油他	2.90%
持株会社	0.76%
電力	1.22%
その他製造	1.87%
合計	72.23%

(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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2011年6月	売建	250,000	20,253,925	20,217,500	0.73%

（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。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	27,272	5,084 138,673,825	5,194 141,668,658	- -	5.23%
2	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	136,587	873 119,310,496	842 115,088,233	- -	4.25%
3	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S 英国	株式 石油・石炭製 品	39,943	2,974 118,823,491	2,851 113,912,547	- -	4.21%
4	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	20,083	4,753 95,462,266	5,166 103,748,959	- -	3.83%
5	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	418,262	234 98,042,520	226 94,688,727	- -	3.50%
6	BNP PARIBAS ユーロ	株式 銀行業	14,775	6,120 90,429,690	6,186 91,408,887	- -	3.38%
7	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC 英国	株式 食料品	24,171	3,398 82,137,551	3,635 87,861,778	- -	3.25%
8	SANOFI ユーロ	株式 医薬品	12,700	5,949 75,559,106	6,289 79,870,863	- -	2.95%
9	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	14,787	4,841 71,591,006	4,586 67,817,176	- -	2.50%
10	SIEMENS AG ユーロ	株式 電気機器	6,432	10,836 69,699,493	10,509 67,598,039	- -	2.50%
11	ALLIANZ SE-REG ユーロ	株式 保険業	6,070	11,925 72,388,173	10,992 66,722,446	- -	2.46%
12	CREDIT SUISSE GROUP AG スイス	株式 銀行業	18,300	3,630 66,445,711	3,490 63,869,919	- -	2.36%
13	HENNES & MAURITZ AB-B スウェーデン	株式 小売業	20,718	2,858 59,229,779	3,040 62,999,439	- -	2.33%
14	BANCO SANTANDER SA ユーロ	株式 銀行業	64,964	965 62,729,122	923 60,011,479	- -	2.22%
15	BASF SE ユーロ	株式 化学	8,329	7,321 60,980,956	7,199 59,964,122	- -	2.21%
16	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製 品	95,091	614 58,456,622	614 58,405,789	- -	2.16%
17	GDF SUEZ ユーロ	株式 電気・ガス業	19,573	3,150 61,661,520	2,935 57,451,377	- -	2.12%
18	PEARSON PLC 英国	株式 新聞・出版	37,614	1,478 55,595,689	1,503 56,550,768	- -	2.09%
19	AHOLD (KONINKLIJKE) NV ユーロ	株式 小売業	47,577	1,131 53,835,261	1,146 54,526,733	- -	2.01%

20	KINGFISHER PLC 英国	株式 小売業	142,485	354 50,555,702	379 54,040,332	- -	2.00%
21	NATIONAL GRID PLC 英国	株式 電気・ガス業	63,058	795 50,183,209	827 52,205,706	- -	1.93%
22	SCHNEIDER ELECTRIC SA ユーロ	株式 機械	3,989	12,789 51,018,113	12,882 51,389,154	- -	1.90%
23	PHILIPS ELECTRONICS NV ユーロ	株式 電気機器	23,098	2,484 57,377,939	2,216 51,187,621	- -	1.89%
24	ZURICH FINANCIAL SERVICES スイス	株式 保険業	2,342	22,841 53,494,109	21,475 50,296,092	- -	1.86%
25	SOCIETE GENERALE-A ユーロ	株式 銀行業	10,280	5,305 54,545,490	4,882 50,194,759	- -	1.85%
26	REXAM PLC 英国	株式 その他製造	95,544	503 48,124,479	524 50,129,131	- -	1.85%
27	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	25,820	2,070 53,467,248	1,931 49,864,738	- -	1.84%
28	GIVAUDAN REG スイス	株式 化学	561	88,519 49,659,288	88,853 49,846,783	- -	1.84%
29	REPSOL YPF SA ユーロ	株式 石油・石炭製品	18,436	2,720 50,148,439	2,654 48,937,331	- -	1.81%
30	RIO TINTO PLC-REG 英国	株式 鉱業	8,482	5,813 49,308,750	5,702 48,367,916	- -	1.79%

(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	97.87%
合計	97.87%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	1.79%
建設業	1.23%
食料品	8.48%
パルプ・紙	1.78%
化学	5.81%
医薬品	9.30%
石油・石炭製品	10.68%
機械	3.49%
電気機器	4.39%
輸送用機器	1.67%
電気・ガス業	4.60%
情報・通信業	6.87%
小売業	6.34%
銀行業	16.22%
保険業	5.29%
サービス業	1.50%
消費材	1.70%

建設資材	1.75%
コンク`ロマリット	1.03%
その他製造	1.85%
新聞・出版	2.09%
合計	97.87%

(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

(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	スウェーデン`クローナ売/円買 2011年6月	売建	348,856	4,541,026	4,563,038	0.17%
		ノルウェークローネ売/円買 2011年6月	売建	113,018	1,680,865	1,694,134	0.06%
		ユーロ売/円買 2011年6月	売建	85,000	9,797,950	9,882,100	0.36%
		ユーロ買/円売 2011年6月	買建	68,276	7,948,072	7,937,069	0.29%
		スイスフラン売/円買 2011年6月	売建	55,101	5,261,581	5,261,581	0.19%

(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。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	53,000	4,176 221,348,665	3,819 202,445,738	- -	7.77%
2	AUSTRALIA & NZLAND BK オーストラリア	株式 銀行業	70,000	2,088 146,204,093	1,911 133,781,921	- -	5.14%
3	COMMONWEALTH BANK OF AUST オーストラリア	株式 銀行業	30,000	4,581 137,452,899	4,375 131,267,910	- -	5.04%
4	SAMSUNG ELECTRONICS 韓国	株式 電気機器	1,950	67,680 131,976,000	66,476 129,629,760	- -	4.98%
5	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 電気機器	587,149	196 115,572,061	211 124,347,590	- -	4.77%
6	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 輸送用機器	5,400	16,694 90,149,760	18,724 101,113,920	- -	3.88%
7	WESFARMERS LIMITED オーストラリア	株式 コンク`ロマリット	32,000	2,874 91,972,787	2,858 91,471,725	- -	3.51%
8	HTC CORPORATION 台湾	株式 電気機器	26,250	3,440 90,310,500	3,299 86,609,250	- -	3.33%
9	LG CHEMICAL LTD 韓国	株式 化学	2,100	37,412 78,565,200	38,352 80,539,200	- -	3.09%
10	RIO TINTO LTD オーストラリア	株式 鉱業	10,000	7,404 74,045,888	7,011 70,113,940	- -	2.69%

11	ORICA LIMITED オーストラリア	株式 化学	26,500	2,339 61,987,769	2,229 59,083,173	- -	2.27%
12	UNITED OVERSEAS BANK シンガポール	株式 銀行業	45,000	1,288 57,994,956	1,265 56,931,912	- -	2.19%
13	SAMSUNG ENGINEERING CO LT 韓国	株式 建設業	3,000	17,709 53,128,800	18,273 54,820,800	- -	2.10%
14	CHEUNG KONG 香港	株式 不動産業	40,000	1,329 53,164,800	1,232 49,296,000	- -	1.89%
15	CSL LIMITED オーストラリア	株式 医薬品	16,000	3,099 49,591,259	2,939 47,030,274	- -	1.81%
16	ASM PACIFIC TECHNOLOGY 香港	株式 電気機器	43,000	1,060 45,614,400	1,084 46,642,960	- -	1.79%
17	CHINATRUST FINANCIAL HOLD 台湾	株式 銀行業	638,400	68 43,566,970	69 44,647,142	- -	1.71%
18	GS ENGINEERING&CONSTRUCT 韓国	株式 建設業	5,000	9,174 45,872,000	8,460 42,300,000	- -	1.62%
19	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES 韓国	株式 機械	1,200	40,457 48,549,120	34,291 41,149,440	- -	1.58%
20	JB HI-FI LTD オーストラリア	株式 小売業	25,500	1,713 43,699,427	1,495 38,131,632	- -	1.46%
21	FUBON FINANCIAL HOLDING 台湾	株式 銀行業	314,983	110 34,819,481	117 36,906,873	- -	1.42%
22	HANA FINANCIAL GROUP 韓国	株式 銀行業	12,500	3,455 43,193,000	2,947 36,848,000	- -	1.41%
23	HUTCHISON WHAMPOA 香港	株式 コンク、ロマ リット	40,000	949 37,980,800	891 35,651,200	- -	1.37%
24	HONG KONG EX & CL 香港	株式 その他金融業	20,000	1,889 37,793,600	1,771 35,422,400	- -	1.36%
25	WOODSIDE PETROLEUM オーストラリア	株式 石油・石炭製 品	8,000	4,069 32,555,138	3,998 31,991,442	- -	1.23%
26	LG HOUSEHOLD & HEALTH 韓国	株式 消費材	1,000	31,584 31,584,000	31,922 31,922,400	- -	1.23%
27	NATIONAL AUSTRALIA BANK オーストラリア	株式 銀行業	13,200	2,302 30,394,654	2,276 30,050,174	- -	1.15%
28	CHINA STEEL CORP 台湾	株式 鉄鋼	308,948	98 30,493,168	96 29,796,181	- -	1.14%
29	SUNCORP GROUP LTD オーストラリア	株式 銀行業	40,000	713 28,532,720	727 29,089,456	- -	1.12%
30	ADELAIDE BRIGHTON LIMITED オーストラリア	株式 建設資材	102,000	286 29,192,104	275 28,127,347	- -	1.08%

(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	96.20%
合計	96.20%

(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	10.84%
建設業	3.73%
食料品	0.98%

繊維製品	0.89%
化学	5.68%
医薬品	1.81%
石油・石炭製品	1.23%
鉄鋼	1.83%
機械	1.58%
電気機器	18.08%
輸送用機器	4.89%
電気・ガス業	0.78%
空運業	0.85%
情報・通信業	1.61%
卸売業	2.12%
小売業	1.46%
銀行業	22.78%
保険業	0.59%
その他金融業	1.36%
不動産業	3.25%
サービス業	1.35%
消費材	1.23%
建設資材	1.08%
造船	0.54%
コンク`ロマリット	5.67%
合計	96.20%

（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）ダイワ好配当日本株マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,770,000	387 686,600,000	375 663,750,000	- -	2.53%
2	三井物産 日本	株式 卸売業	440,000	1,407 619,111,600	1,384 608,960,000	- -	2.32%
3	エーザイ 日本	株式 医薬品	191,000	2,976 568,542,973	3,090 590,190,000	- -	2.25%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	157,000	2,993 469,934,400	3,090 485,130,000	- -	1.85%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	123,000	3,763 462,887,358	3,820 469,860,000	- -	1.79%
6	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	196,000	2,515 492,940,000	2,350 460,600,000	- -	1.76%

7	日産自動車	日本	株式 輸送用機器	482,000	769 370,826,235	814 392,348,000	- -	1.50%
8	トヨタ自動車	日本	株式 輸送用機器	115,000	3,240 372,600,000	3,400 391,000,000	- -	1.49%
9	日東電工	日本	株式 化学	91,500	4,280 391,620,000	4,245 388,417,500	- -	1.48%
10	M C J	日本	株式 電気機器	26,340	16,770 441,721,800	13,660 359,804,400	- -	1.37%
11	武田薬品	日本	株式 医薬品	90,000	3,928 353,600,000	3,865 347,850,000	- -	1.33%
12	フェローテック	日本	株式 電気機器	162,000	1,781 288,522,000	2,082 337,284,000	- -	1.29%
13	タツタ電線	日本	株式 非鉄金属	760,000	342 259,920,000	436 331,360,000	- -	1.26%
14	パイオラックス	日本	株式 金属製品	178,100	1,807 321,826,700	1,808 322,004,800	- -	1.23%
15	T D K	日本	株式 電気機器	75,000	4,243 318,245,633	4,280 321,000,000	- -	1.22%
16	日本ピラ - 工業	日本	株式 機械	499,000	673 335,827,000	625 311,875,000	- -	1.19%
17	理想科学工業	日本	株式 機械	246,400	1,306 321,798,400	1,244 306,521,600	- -	1.17%
18	ラウンドワン	日本	株式 サービス業	580,000	455 263,900,000	516 299,280,000	- -	1.14%
19	大東建託	日本	株式 建設業	43,000	6,230 267,890,000	6,720 288,960,000	- -	1.10%
20	住友精密	日本	株式 機械	399,000	666 265,954,239	703 280,497,000	- -	1.07%
21	キャノン	日本	株式 電気機器	70,000	3,670 256,900,000	3,905 273,350,000	- -	1.04%
22	愛知電機	日本	株式 電気機器	962,000	295 283,790,000	277 266,474,000	- -	1.02%
23	村上開明堂	日本	株式 輸送用機器	283,000	1,096 310,168,000	939 265,737,000	- -	1.01%
24	ファナック	日本	株式 電気機器	20,500	13,107 268,713,765	12,490 256,045,000	- -	0.98%
25	NECキャピタルソリューション	日本	株式 その他金融業	238,800	1,291 308,290,800	1,071 255,754,800	- -	0.98%
26	東京ラヂエ - タ -	日本	株式 輸送用機器	491,400	514 252,579,600	512 251,596,800	- -	0.96%
27	アルプス物流	日本	株式 陸運業	295,500	812 239,946,000	809 239,059,500	- -	0.91%
28	G M B	日本	株式 輸送用機器	169,300	1,327 224,791,488	1,397 236,512,100	- -	0.90%
29	三菱商事	日本	株式 卸売業	113,000	2,184 246,871,500	2,057 232,441,000	- -	0.89%
30	自動車部品	日本	株式 輸送用機器	552,000	384 211,968,000	420 231,840,000	- -	0.88%

(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	93.69%
投資証券	0.56%
合計	94.26%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	0.83%
建設業	4.30%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.47%
化学	6.65%
医薬品	4.08%
石油・石炭製品	1.53%
ゴム製品	0.68%
ガラス・土石製品	0.68%
鉄鋼	2.94%
非鉄金属	1.67%
金属製品	4.21%
機械	6.76%
電気機器	11.15%
輸送用機器	11.28%
精密機器	0.93%
その他製品	0.37%
陸運業	1.92%
海運業	0.55%
倉庫・運輸関連業	0.63%
情報・通信業	4.70%
卸売業	8.33%
小売業	4.00%
銀行業	5.20%
その他金融業	1.28%
不動産業	3.69%
サービス業	4.21%
合計	93.69%

（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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	日経平均先物 2011年6月	買建	45	430,200,000	436,050,000	1.66%
		TOPIX先物 2011年6月	買建	15	125,775,000	125,625,000	0.48%

（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）株価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。

(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)
設定時 (平成17年11月14日)	1,000,000	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成18年5月10日)	477,818,402	480,615,713	1.0215	1.0275
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,073,402,313	3,090,649,361	1.0556	1.0615
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	4,995,411,451	5,026,275,763	1.1207	1.1277
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	6,053,001,955	6,092,366,621	1.0632	1.0701
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	5,595,838,241	5,635,179,981	0.9950	1.0020
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	4,210,794,891	4,246,901,969	0.8163	0.8233
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	4,078,083,050	4,112,743,901	0.8234	0.8304
第8特定期間末 (平成21年11月10日)	4,188,672,164	4,223,860,620	0.8320	0.8390
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	3,987,129,147	4,021,010,092	0.8238	0.8308
平成22年5月末日	3,884,084,199	-	0.8047	-
6月末日	3,813,025,994	-	0.7935	-
7月末日	3,820,749,775	-	0.8029	-
8月末日	3,748,212,402	-	0.7921	-
9月末日	3,776,135,279	-	0.8077	-
10月末日	3,699,646,595	-	0.7956	-
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	3,709,986,656	3,742,470,859	0.7995	0.8065
11月末日	3,638,742,141	-	0.7932	-
12月末日	3,602,571,636	-	0.7985	-
平成23年1月末日	3,538,872,135	-	0.8009	-
2月末日	3,497,722,469	-	0.8073	-
3月末日	3,440,872,182	-	0.8071	-
4月末日	3,436,675,160	-	0.8175	-
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	3,340,858,725	3,370,124,274	0.7991	0.8061
5月末日	3,313,432,193	-	0.8023	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0090
第2特定期間	0.0180
第3特定期間	0.0190
第4特定期間	0.0210
第5特定期間	0.0210
第6特定期間	0.0210
第7特定期間	0.0210
第8特定期間	0.0210
第9特定期間	0.0210
第10特定期間	0.0210
第11特定期間	0.0210

（注）1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1特定期間	3.1
第2特定期間	5.1
第3特定期間	8.0
第4特定期間	3.3
第5特定期間	4.4
第6特定期間	15.8
第7特定期間	3.4
第8特定期間	3.6
第9特定期間	1.5
第10特定期間	0.4
第11特定期間	2.6

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1) 投資状況（平成23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	3,736,174,611	99.31
内 日本	3,736,174,611	99.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	25,973,662	0.69
純資産総額	3,762,148,273	100.00

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(2) 投資資産（平成23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

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ダイワ・外債ソブリン・マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	2,284,328,619	1.14060 2,605,505,227	1.1606 2,651,191,795	- -	70.47%
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 -	359,922,553	1.07360 386,412,859	1.0431 375,435,215	- -	9.98%
3	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 -	179,888,070	1.02510 184,403,262	1.0322 185,680,465	- -	4.94%
4	ダイワ・グローバルREIT ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	195,666,921	0.92270 180,541,873	0.9468 185,257,440	- -	4.92%
5	ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	88,457,012	1.33580 118,160,876	1.3237 117,090,546	- -	3.11%
6	ダイワ欧州好配当株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	126,552,456	0.87350 110,543,570	0.8835 111,809,094	- -	2.97%
7	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 -	120,256,556	0.91120 109,577,773	0.9123 109,710,056	- -	2.92%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.31%
合計	99.31%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(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)
設定時 (平成17年11月14日)	1,000,000	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成18年5月10日)	717,817,859	723,366,945	1.0340	1.0420
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,303,895,005	3,330,974,555	1.0884	1.0973
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	6,348,295,670	6,402,292,024	1.1653	1.1752
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	7,597,939,640	7,666,585,375	1.0955	1.1054
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	6,966,783,065	7,036,210,388	1.0027	1.0127
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	5,137,363,149	5,204,761,362	0.7622	0.7722
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	5,082,311,828	5,148,143,388	0.7715	0.7815

第8特定期間末 (平成21年11月10日)	5,130,284,415	5,196,749,952	0.7708	0.7808
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	4,747,854,086	4,811,653,675	0.7442	0.7542
平成22年5月末日	4,594,435,005	-	0.7192	-
6月末日	4,434,573,128	-	0.7019	-
7月末日	4,453,569,047	-	0.7119	-
8月末日	4,342,545,932	-	0.6996	-
9月末日	4,382,635,317	-	0.7169	-
10月末日	4,221,926,927	-	0.6983	-
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	4,225,286,088	4,285,461,237	0.7022	0.7122
11月末日	4,162,810,512	-	0.6959	-
12月末日	4,046,961,334	-	0.6903	-
平成23年1月末日	4,022,758,465	-	0.6942	-
2月末日	4,005,660,239	-	0.7021	-
3月末日	3,962,996,609	-	0.7056	-
4月末日	3,946,872,642	-	0.7205	-
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	3,784,311,567	3,838,978,686	0.6922	0.7022
5月末日	3,762,148,273	-	0.6994	-

分配の推移

	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0140
第2特定期間	0.0260
第3特定期間	0.0280
第4特定期間	0.0300
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300
第11特定期間	0.0300

（注）1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

収益率の推移

	収益率（％）
第1特定期間	4.8
第2特定期間	7.8
第3特定期間	9.6
第4特定期間	3.4
第5特定期間	5.7
第6特定期間	21.0

第7特定期間	5.2
第8特定期間	3.8
第9特定期間	0.4
第10特定期間	1.6
第11特定期間	2.8

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(1) 投資状況（平成23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	12,525,789,837	99.32
内 日本	12,525,789,837	99.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	85,730,793	0.68
純資産総額	12,611,520,630	100.00

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(2) 投資資産（平成23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

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	ダイワ好配当日本株マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	4,273,570,570	1.07360 4,588,105,397	1.0431 4,457,761,461	- -	35.35%

2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	2,138,732,416	1.14060 2,439,438,194	1.1606 2,482,212,842	- -	19.68%
3	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 -	1,653,349,538	0.87350 1,444,200,826	0.8835 1,460,734,316	- -	11.58%
4	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	1,099,998,501	1.33580 1,469,378,009	1.3237 1,456,068,015	- -	11.55%
5	ダイワ北米好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 -	1,570,251,008	0.91120 1,430,812,723	0.9123 1,432,539,994	- -	11.36%
6	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 -	599,679,264	1.02510 614,731,228	1.0322 618,988,936	- -	4.91%
7	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 -	652,180,263	0.92270 601,766,735	0.9468 617,484,273	- -	4.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.32%
合計	99.32%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(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）
設定時 (平成17年11月14日)	1,000,000	-	1.0000	-
第1特定期間末 (平成18年5月10日)	511,852,757	527,694,636	1.0916	1.1254
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,028,587,268	3,126,137,019	1.0506	1.0844
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	20,149,767,057	20,583,109,523	1.1084	1.1323
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	31,541,417,114	31,669,290,974	0.9864	0.9904
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	27,088,263,431	27,212,249,921	0.8737	0.8777
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	17,356,839,161	17,473,272,452	0.5963	0.6003
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	17,160,751,063	17,274,735,906	0.6021	0.6061
第8特定期間末 (平成21年11月10日)	17,492,350,214	17,602,733,833	0.6336	0.6376
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	15,970,647,028	16,070,526,287	0.6396	0.6436
平成22年5月末日	15,110,109,454	-	0.6105	-
6月末日	14,314,435,435	-	0.5865	-
7月末日	14,517,307,013	-	0.6030	-
8月末日	13,676,773,351	-	0.5753	-
9月末日	14,049,407,433	-	0.6031	-
10月末日	13,504,815,410	-	0.5911	-
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	13,787,105,748	13,878,015,417	0.6066	0.6106
11月末日	13,599,212,222	-	0.6057	-
12月末日	13,792,171,161	-	0.6286	-
平成23年1月末日	13,869,955,511	-	0.6433	-
2月末日	13,886,328,202	-	0.6567	-
3月末日	13,517,252,753	-	0.6492	-
4月末日	13,398,202,026	-	0.6556	-
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	12,945,429,976	13,026,625,221	0.6377	0.6417
5月末日	12,611,520,630	-	0.6342	-

分配の推移

	1口当たり分配金（円）
第1特定期間	0.0370
第2特定期間	0.0720
第3特定期間	0.1020
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0120
第6特定期間	0.0120
第7特定期間	0.0120
第8特定期間	0.0120
第9特定期間	0.0120
第10特定期間	0.0120
第11特定期間	0.0120

（注）1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

収益率の推移

	収益率（％）
第1特定期間	12.9
第2特定期間	2.8
第3特定期間	15.2
第4特定期間	7.2
第5特定期間	10.2
第6特定期間	30.4
第7特定期間	3.0
第8特定期間	7.2
第9特定期間	2.8
第10特定期間	3.3
第11特定期間	7.1

[次へ](#)

2011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	6,994円
純資産総額	37億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.5%
3カ月間	2.5%
6カ月間	4.9%
1年間	5.9%
3年間	-12.9%
5年間	-4.1%
設定来	-0.0%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 600円 設定来分配金合計額: 3,080円

決算期	第22期	第23期	第24期	第25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
	09年7月	09年9月	09年11月	10年1月	10年3月	10年5月	10年7月	10年9月	10年11月	11年1月	11年3月	11年5月
分配金	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100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	36	69.0%	米ドル	23.3%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.3%
国内株式・先物	180	9.6%	ユーロ	18.0%	最終利回り(%)	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	0.2%
外国株式	197	8.0%	日本円	15.8%	修正デュレーション	三井物産	日本	0.2%
外国リート等	190	5.5%	豪ドル	12.5%	残存年数	イーザイ	日本	0.2%
国内リート	30	4.9%	カナダ・ドル	9.7%	債券格付別構成	本田技研	日本	0.2%
			英ポンド	8.1%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.7%
			ポーランド・ズロチ	4.4%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	2.4%	A	日本リテールファンド	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	1.3%	BBB	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	0.3%
コール・ローン、その他		3.2%	その他	4.4%	BB	森トラスト総合リート	日本	0.3%
合計	633	-	合計	100.0%	合計	合計		3.3%

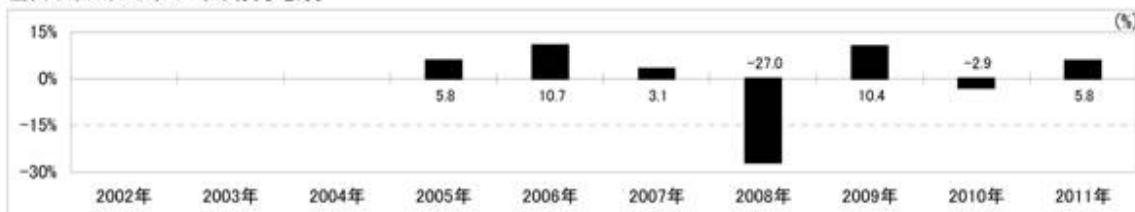
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※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。

・2005年は設定日(11月14日)から年末、2011年は5月31日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

2011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	6,342円
純資産総額	126億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-2.7%
3カ月間	-2.2%
6カ月間	6.7%
1年間	8.0%
3年間	-20.9%
5年間	-15.6%
設定来	-9.0%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 240円 設定来分配金合計額: 3,370円

決算期	第22期	第23期	第24期	第25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
	09年7月	09年9月	09年11月	10年1月	10年3月	10年5月	10年7月	10年9月	10年11月	11年1月	11年3月	11年5月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40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	
国内株式・先物	180	33.9%	日本円	41.4%	直接利回り(%)	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	0.9%	
外国株式	197	30.6%	米ドル	18.0%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%	
外国債券	36	19.3%	ユーロ	9.8%	修正デュレーション	三井物産	日本	0.8%	
外国リート等	190	7.6%	豪ドル	8.3%	残存年数	イーザイ	日本	0.8%	
国内リート	30	5.0%	英ポンド	6.0%	債券格付別構成	本田技研	日本	0.7%	
			カナダ・ドル	3.5%	AAA	80.5%	日本ビルファンド	日本	0.7%
			韓国ウォン	2.6%	AA	12.0%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
			スイス・フラン	2.1%	A	7.5%	日本リテールファンド	日本	0.3%
			台湾ドル	2.0%	BBB	-	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	0.3%
コール・ローン、その他		4.4%	その他	6.3%	BB	-	森トラスト総合リート	日本	0.3%
合計	633	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.2%	

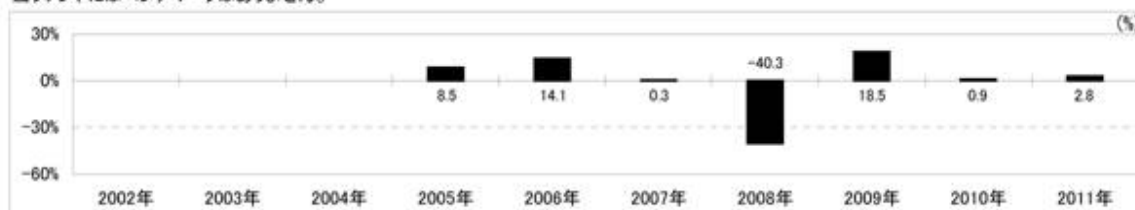
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※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。

・2005年は設定日(11月14日)から年末、2011年は5月31日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

(4) 【設定及び解約の実績】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	471,050,602	4,288,699
第2特定期間	2,485,711,689	41,842,503
第3特定期間	2,085,303,392	539,715,156
第4特定期間	1,534,637,676	298,662,544
第5特定期間	294,023,666	363,383,984
第6特定期間	111,742,716	577,380,392
第7特定期間	32,560,536	238,087,873
第8特定期間	197,820,936	115,863,494
第9特定期間	164,875,064	359,366,499
第10特定期間	52,988,997	252,523,700
第11特定期間	48,215,226	508,022,904

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	702,339,171	9,143,694
第2特定期間	2,363,634,810	22,245,139
第3特定期間	2,727,448,223	315,105,981
第4特定期間	1,799,847,583	312,149,776
第5特定期間	423,726,393	411,454,019
第6特定期間	213,869,039	421,945,239
第7特定期間	84,850,180	237,290,082
第8特定期間	189,497,121	121,502,962
第9特定期間	241,527,824	516,944,531
第10特定期間	104,295,368	466,739,317
第11特定期間	43,351,252	594,154,241

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	493,925,430	26,011,029
第2特定期間	2,435,507,421	21,714,884
第3特定期間	15,546,370,534	250,183,016
第4特定期間	14,582,776,935	785,579,088
第5特定期間	600,862,589	1,572,719,143
第6特定期間	191,255,824	2,087,048,820
第7特定期間	209,074,004	814,109,713
第8特定期間	196,014,849	1,092,280,415

第9特定期間	94,460,544	2,731,787,121
第10特定期間	80,269,976	2,322,667,589
第11特定期間	93,140,306	2,521,746,174

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

第3 【ファンドの経理状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前特定期間（平成22年5月11日から平成22年11月10日まで）及び当特定期間（平成22年11月11日から平成23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】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前期	当期
	平成22年11月10日現在	平成23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	44,118,845	30,102,004
親投資信託受益証券	3,672,808,685	3,317,106,947
未収入金	34,400,000	45,000,000
流動資産合計	3,751,327,530	3,392,208,951
資産合計	3,751,327,530	3,392,208,951
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	32,484,203	29,265,549
未払解約金	807,831	14,767,745
未払受託者報酬	329,054	299,118
未払委託者報酬	7,568,568	6,879,830
その他未払費用	151,218	137,984
流動負債合計	41,340,874	51,350,226
負債合計	41,340,874	51,350,226
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,640,600,430	4,180,792,752
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 930,613,774	839,934,027
(分配準備積立金)	122,076,485	118,395,708
元本等合計	3,709,986,656	3,340,858,725
純資産合計	3,709,986,656	3,340,858,725
負債純資産合計	3,751,327,530	3,392,208,951

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	24,563	19,828
有価証券売買等損益	6,174,906	112,798,262
営業収益合計	6,199,469	112,818,090
営業費用		
受託者報酬	1,008,655	920,478
委託者報酬	1 23,200,072	21,171,723
その他費用	151,218	137,984
営業費用合計	24,359,945	22,230,185
営業利益又は営業損失()	18,160,476	90,587,905
経常利益又は経常損失()	18,160,476	90,587,905
当期純利益又は当期純損失()	18,160,476	90,587,905
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	142,779	733,337
期首剰余金又は期首欠損金()	853,005,986	930,613,774
剰余金増加額又は欠損金減少額	50,271,426	101,358,728
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	50,271,426	101,358,728
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,492,120	9,611,501
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	10,492,120	9,611,501
分配金	2 99,083,839	90,922,048
期末剰余金又は期末欠損金()	930,613,774	839,934,027

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23年5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。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	4,840,135,133円 52,988,997円 252,523,700円	4,640,600,430円 48,215,226円 508,022,904円
2. 特定期間末日における受益権の総数	4,640,600,430口	4,180,792,752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930,613,774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839,934,027円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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	978,665円	865,908円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成22年5月11日 至平成22年7月12日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,945,003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（183,350,007円）及び分配準備積立金（169,313,409円）より分配対象額は370,608,419円（1万口当たり772.59円）であり、うち33,578,660円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自平成22年11月11日 至平成23年1月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,846,281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（173,524,913円）及び分配準備積立金（117,629,573円）より分配対象額は308,000,767円（1万口当たり685.11円）であり、うち31,469,654円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

	<p>（自平成22年7月13日 至平成22年9月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,092,849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（181,035,449円）及び分配準備積立金（150,415,357円）より分配対象額は347,543,655円（1万口当たり736.75円）であり、うち33,020,976円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成22年9月11日 至平成22年11月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,587,521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（178,445,962円）及び分配準備積立金（130,973,167円）より分配対象額は333,006,650円（1万口当たり717.59円）であり、うち32,484,203円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成23年1月12日 至平成23年3月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（18,720,700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（151,774,388円）及び分配準備積立金（113,495,937円）より分配対象額は283,991,025円（1万口当たり658.54円）であり、うち30,186,845円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p> <p>（自平成23年3月11日 至平成23年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,685,484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（132,722,134円）及び分配準備積立金（113,342,999円）より分配対象額は265,750,617円（1万口当たり635.65円）であり、うち29,265,549円（1万口当たり70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	前期 自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	当期 自平成22年11月11日 至平成23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。	同左

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。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 平成22年11月10日現在	当期 平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 平成22年11月10日現在	当期 平成23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	99,205,403	15,399,991

合計	99,205,403	15,399,991
----	------------	------------

(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 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左

(1口当たり情報)

	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23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)	0.7995円 (7,995円)	0.7991円 (7,991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	1,017,872,004	1,160,984,807	
	ダイワ日本国債マザーファンド	1,071,738,421	1,190,808,559	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	173,204,855	159,816,119	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	159,285,512	163,283,578	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	109,678,179	99,938,756	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	115,427,756	100,826,144	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	77,879,226	104,031,070	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	314,286,433	337,417,914	
親投資信託受益証券 合計		3,039,372,386	3,317,106,947	
合計		3,039,372,386	3,317,106,947	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	-	1,058,416,942
コール・ローン	884,942,781	459,678,210
国債証券	159,342,614,966	119,296,622,293
特殊債券	6,471,180,336	15,150,984,941
派生商品評価勘定	26,462,190	-
未収入金	22,256,746,049	-
未収利息	2,668,084,894	2,272,550,107
前払費用	673,880,959	332,787,641
流動資産合計	192,323,912,175	138,571,040,134
資産合計	192,323,912,175	138,571,040,134
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,000,000	-
前受金	189,989,098	-
未払金	21,373,632,933	-
未払解約金	421,300,000	300,800,000
流動負債合計	21,992,922,031	300,800,000
負債合計	21,992,922,031	300,800,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	150,922,872,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,408,117,751	17,046,988,880
元本等合計	170,330,990,144	138,270,240,134
純資産合計	170,330,990,144	138,270,240,134
負債純資産合計	192,323,912,175	138,571,040,134

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券及び特殊債券 同左
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	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	196,327,796,902円	150,922,872,393円
同期中における追加設定元本額	5,555,229円	158,071,892円
同期中における一部解約元本額	45,410,479,738円	29,857,693,031円
同期末における元本の内訳		
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）	14,959,817,059円	12,553,661,783円
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	147,941,623円	- 円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス/毎月分配型）	3,266,078,269円	2,501,718,323円
北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	2,999,141,836円	2,857,376,061円
福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	1,733,861,765円	1,432,098,429円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	8,646,221,712円	6,729,150,025円

ダイワ・バランス2資産(外債・好配当日本株)(毎月分配型)	81,795,975円	76,888,912円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	115,010,825円	107,781,177円
新潟県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	1,650,849,579円	1,480,611,239円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,121,861,003円	1,017,872,004円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	2,577,365,145円	2,332,347,640円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	2,352,701,242円	2,142,208,628円
FITネット・三県応援ファンド(毎月分配型)	1,612,814,200円	1,331,850,176円
長野応援ファンド(毎月分配型)	1,066,905,181円	977,351,607円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	28,033,134円	26,620,786円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	66,373,732円	59,601,597円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	52,382,950円	50,725,747円
栃木応援・外債バランスファンド(毎月分配型)	1,555,983,309円	1,385,451,264円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	976,878,547円	902,557,439円
北東北三県応援・外債バランスファンド(毎月分配型)	1,603,790,234円	1,432,829,478円
6資産バランスファンド(分配型)	6,432,877,019円	5,335,421,146円
6資産バランスファンド(成長型)	399,222,700円	380,712,750円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	77,109,316,568円	58,907,103,335円
富山応援ファンドPART2(地域企業株・外債バランス/隔月分配型)	911,895,892円	769,784,544円
奈良応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	446,585,678円	361,148,688円
ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)	1,041,415,133円	922,008,703円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	1,065,003,323円	733,653,472円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	6,224,007,973円	4,668,389,844円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	579,016,136円	486,002,314円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	134,512,777円	118,385,332円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	1,208,033,679円	1,213,059,226円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	448,646,566円	419,269,096円
愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	1,096,048,710円	966,436,499円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	6,508,926,106円	5,976,158,956円

地球環境株・外債バランス・ファンド	658,314,013円	538,221,117円
ダイワ円債重視バランスファンド （奇数月決算型）	1,974,637円	1,995,180円
ダイワ円債重視バランスファンド （資産形成型）	129,749円	137,144円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1 年決算型）	41,138,414円	26,661,593円
計	150,922,872,393円	121,223,251,254円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 特定期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	150,922,872,393口	121,223,251,254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 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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。	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ため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還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。	同左

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	平成22年11月10日現在	平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成22年11月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	平成23年5月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
	国債証券	2,335,738,380
特殊債券	37,018,376	228,846,118
合計	2,372,756,756	3,045,303,393

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成22年10月13日から平成22年11月10日まで、及び平成23年4月12日から平成23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	平成22年11月10日現在			平成23年5月10日現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	4,774,325,000	-	4,782,100,000	7,775,000	-	-	-	-
ユーロ	4,774,325,000	-	4,782,100,000	7,775,000	-	-	-	-
買 建	4,811,925,000	-	4,838,162,190	26,237,190	-	-	-	-
アメリカ・ドル	2,531,925,000	-	2,550,365,415	18,440,415	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	2,280,000,000	-	2,287,796,775	7,796,775	-	-	-	-
合計	9,586,250,000	-	9,620,262,190	18,462,190	-	-	-	-

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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。

特定期間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。

特定期間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。

- ・ 特定期間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。
- ・ 特定期間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) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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、特定期間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)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1286円 (11,286円)	1.1406円 (11,406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	11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	アメリカ・ドル 85,000,000.000	アメリカ・ドル 116,389,650.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	56,700,000.000	81,138,267.000	

	8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	42,200,000.000	60,583,164.000	
	7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	11,000,000.000	15,766,080.000	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	30,000,000.000	29,676,300.000	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	25,000,000.000	26,873,000.000	
	6.875% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230927	50,000,000.000	58,405,500.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 299,900,000.000 (24,081,970,000)	アメリカ・ドル 388,831,961.000 (31,223,206,468)	
イギリス・ポンド	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	8,800,000.000	11,995,280.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	60,200,000.000	84,087,360.000	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 69,000,000.000 (9,085,920,000)	イギリス・ポンド 96,082,640.000 (12,652,162,035)	
オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	57,500,000.000	58,973,150.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 57,500,000.000 (4,970,875,000)	オーストラリア・ドル 58,973,150.000 (5,098,228,818)	
カナダ・ドル	10.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140315	37,396,000.000	45,893,867.040	
	10.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210315	1,700,000.000	2,757,230.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	14,500,000.000	21,273,385.000	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	37,600,000.000	61,237,616.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	34,800,000.000	54,113,652.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	13,000,000.000	15,969,590.000	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	19,600,000.000	21,387,128.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 158,596,000.000 (13,198,359,120)	カナダ・ドル 222,632,468.040 (18,527,473,991)	
スウェーデン・クローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	265,000,000.000	296,336,250.000	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	20,000,000.000	20,898,800.000	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 285,000,000.000 (3,650,850,000)	スウェーデン・クローナ 317,235,050.000 (4,063,780,990)	
チェコ・コルナ	6.95% Czech Republic Government Bond 20160126	314,000,000.000	369,436,700.000	
チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 314,000,000.000 (1,488,360,000)	チェコ・コルナ 369,436,700.000 (1,751,129,958)	

デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	100,000,000.000	138,094,000.000	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	2,200,000.000	2,363,856.000	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	50,000,000.000	58,322,500.000	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 152,200,000.000 (2,348,446,000)	デンマーク・クローネ 198,780,356.000 (3,067,180,893)	
ノルウェー・クローネ	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	ノルウェー・クローネ 26,500,000.000	ノルウェー・クローネ 28,581,840.000	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 26,500,000.000 (387,165,000)	ノルウェー・クローネ 28,581,840.000 (417,580,683)	
ポーランド・ズロチ	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	ポーランド・ズロチ 246,500,000.000	ポーランド・ズロチ 253,510,460.000	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	30,000,000.000	29,169,300.000	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 276,500,000.000 (8,073,800,000)	ポーランド・ズロチ 282,679,760.000 (8,254,248,992)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	62,000,000.000	83,965,360.000	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	22,000,000.000	26,424,420.000	
	8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	43,000,000.000	59,601,870.000	
	4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	18,000,000.000	17,929,080.000	
	5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	15,000,000.000	13,999,500.000	
	3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	40,000,000.000	37,334,000.000	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	49,700,000.000	58,369,668.000	
ユーロ 小計		ユーロ 249,700,000.000 (28,727,985,000)	ユーロ 297,623,898.000 (34,241,629,465)	
国債証券 合計		96,013,730,120 [96,013,730,120]	119,296,622,293 [119,296,622,293]	
特殊債券	オーストラリア・ドル	6.25% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20191204	オーストラリア・ドル 25,000,000.000	オーストラリア・ドル 24,888,750.000
		6% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20200820	75,000,000.000	72,989,250.000
		6% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20200806	80,000,000.000	77,379,200.000
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 180,000,000.000 (15,561,000,000)	オーストラリア・ドル 175,257,200.000 (15,150,984,941)
特殊債券 合計		15,561,000,000 [15,561,000,000]	15,150,984,941 [15,150,984,941]	
合計		111,574,730,120 [111,574,730,120]	134,447,607,234 [134,447,607,234]	

- (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 7銘柄	100%	23.2%
イギリス・ポンド	国債証券 2銘柄	100%	9.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 1銘柄 特殊債券 3銘柄	100%	15.1%
カナダ・ドル	国債証券 7銘柄	100%	13.8%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	3.0%
チェコ・コルナ	国債証券 1銘柄	100%	1.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	2.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	6.1%
ユーロ	国債証券 7銘柄	100%	25.5%

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。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成22年11月10日現在	平成23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	2,255,774,195	542,101,454
国債証券	44,741,685,059	122,919,599,159
未収利息	204,531,096	620,667,477
前払費用	47,556,771	74,325,364
流動資産合計	47,249,547,121	124,156,693,454
資産合計	47,249,547,121	124,156,693,454
負債の部		
流動負債		
未払金	1,550,208,900	465,900,400
未払解約金	1,400,335	3,000,984
流動負債合計	1,551,609,235	468,901,384
負債合計	1,551,609,235	468,901,384
純資産の部		
元本等		
元本	41,150,230,523	111,321,162,408
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,547,707,363	12,366,629,662
元本等合計	45,697,937,886	123,687,792,070
純資産合計	45,697,937,886	123,687,792,070
負債純資産合計	47,249,547,121	124,156,693,454

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,438,571,155円	41,150,230,523円
同期中における追加設定元本額	20,504,120,261円	72,341,358,196円
同期中における一部解約元本額	1,792,460,893円	2,170,426,311円

同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドVA（適格機関投資家専用）	- 円	263,228円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,154,363,074円	1,071,738,421円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	28,399,352円	28,005,998円
6資産バランスファンド（分配型）	1,292,619,586円	1,129,256,313円
6資産バランスファンド（成長型）	411,451,909円	384,202,991円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	36,998,969,313円	107,754,695,776円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	1,063,872,462円	759,205,024円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	166,175,848円	160,747,457円
ダイワ日本国債三分法（四半期分配型）	34,378,979円	33,047,200円
計	41,150,230,523円	111,321,162,408円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	41,150,230,523口	111,321,162,408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 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	同左
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。	同左

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。	同左
----------------------------	--	----

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年11月10日現在	平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月10日現在	平成23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	7,486,626	879,644,360
合計	7,486,626	879,644,360

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年3月11日から平成22年11月10日まで、及び平成23年3月11日から平成23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

平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1105円 (11,105円)	1.1111円 (11,111円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 6 利付国債 2 0 年	4,268,000,000	4,369,322,320	
	1 7 利付国債 2 0 年	809,000,000	827,631,270	
	1 8 利付国債 2 0 年	2,806,000,000	2,953,567,540	
	1 9 利付国債 2 0 年	3,527,000,000	3,800,942,090	
	2 2 利付国債 2 0 年	3,875,000,000	4,241,226,250	
	2 3 利付国債 2 0 年	3,969,000,000	4,461,751,349	
	2 4 利付国債 2 0 年	3,379,000,000	3,808,572,270	
	2 7 利付国債 2 0 年	4,021,000,000	4,655,352,960	
	2 8 利付国債 2 0 年	2,943,000,000	3,468,384,360	
	2 9 利付国債 2 0 年	4,075,000,000	4,749,575,500	
	3 0 利付国債 2 0 年	97,000,000	110,950,540	
	3 2 利付国債 2 0 年	2,888,000,000	3,342,657,840	
	3 3 利付国債 2 0 年	3,729,000,000	4,384,632,780	
	3 4 利付国債 2 0 年	3,254,000,000	3,810,108,600	
	3 7 利付国債 2 0 年	2,178,000,000	2,516,766,120	
	3 8 利付国債 2 0 年	5,086,000,000	5,771,796,240	
	4 0 2 0 年国債	3,427,000,000	3,801,262,670	
	4 2 2 0 年国債	3,833,000,000	4,341,102,480	
	4 3 2 0 年国債	4,487,000,000	5,200,567,610	
	4 4 2 0 年国債	2,655,000,000	2,991,016,800	
	4 8 2 0 年国債	6,086,000,000	6,865,129,720	
	4 9 2 0 年国債	1,158,000,000	1,261,536,780	
	5 1 2 0 年国債	140,000,000	151,253,200	
	5 2 2 0 年国債	2,908,000,000	3,171,028,600	
	5 4 2 0 年国債	4,437,000,000	4,879,679,490	
	5 5 2 0 年国債	34,000,000	36,682,600	
	5 6 2 0 年国債	6,930,000,000	7,476,846,300	
	5 8 2 0 年国債	565,000,000	603,018,850	
	5 9 2 0 年国債	95,000,000	99,281,650	
	6 3 2 0 年国債	3,018,000,000	3,169,171,620	
	6 4 2 0 年国債	4,205,000,000	4,454,608,800	
	6 5 2 0 年国債	27,000,000	28,538,190	
	6 8 2 0 年国債	505,000,000	550,500,500	
7 0 2 0 年国債	5,653,000,000	6,292,863,070		
7 4 2 0 年国債	940,000,000	1,008,281,600		
7 5 2 0 年国債	920,000,000	984,998,000		
8 0 2 0 年国債	1,683,000,000	1,798,453,800		
8 2 2 0 年国債	2,095,000,000	2,234,233,700		
8 3 2 0 年国債	3,070,000,000	3,267,186,100		
8 6 2 0 年国債	900,000,000	979,119,000		
国債証券 合計		110,675,000,000	122,919,599,159	
合計		110,675,000,000	122,919,599,159	

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。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	11,494,683,702	13,957,079,859
コール・ローン	1,468,443,808	4,890,252,146
投資証券	424,434,708,003	524,776,453,910
派生商品評価勘定	2,253,489	51,140
未収入金	979,015,134	8,556,059,071
未収配当金	715,453,358	2,432,487,159
流動資産合計	439,094,557,494	554,612,383,285
資産合計	439,094,557,494	554,612,383,285
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,055,738	4,674,344
未払金	3,631,597,611	5,877,085,987
未払解約金	159,000,000	191,300,000
流動負債合計	3,803,653,349	6,073,060,331
負債合計	3,803,653,349	6,073,060,331
純資産の部		
元本等		
元本	1 511,846,743,484	594,500,161,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 76,555,839,339	45,960,838,626
元本等合計	435,290,904,145	548,539,322,954
純資産合計	435,290,904,145	548,539,322,954
負債純資産合計	439,094,557,494	554,612,383,285

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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 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。	投資証券 同左
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	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの特定期間末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。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落日において、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。	受取配当金 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,282,686,283円	511,846,743,484円
同期中における追加設定元本額	152,961,414,773円	117,559,004,680円
同期中における一部解約元本額	10,397,357,572円	34,905,586,584円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	445,318,731,841円	557,255,148,759円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	152,820,752円	134,020,927円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	218,591,588円	173,204,855円

インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	247,005,643円	198,336,766円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	771,210,099円	685,843,841円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	5,561,852円	4,605,594円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	5,939,633円	4,891,368円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	14,418,949円	15,227,894円
6資産バランスファンド(分配型)	1,725,224,736円	1,297,014,608円
6資産バランスファンド(成長型)	2,163,396,902円	1,867,566,187円
ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)	141,157,248円	114,585,647円
りそな ワールド・リート・ファンド	50,922,794,508円	24,160,503,981円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	1,392,736,263円	872,204,102円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	42,694,516円	36,147,954円
常陽3分法ファンド	2,985,608,825円	2,540,569,530円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	621,135,475円	528,402,562円
ダイワ・海外株式&REITファンド(毎月分配型)	191,903,105円	155,662,075円
ダイワ円債重視バランスファンド(奇数月決算型)	1,395,456円	1,259,697円
ダイワ円債重視バランスファンド(資産形成型)	88,230円	86,133円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	107,866,707円	121,290,104円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	131,435,186円	141,862,530円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	111,143,505円	125,571,089円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	1,527,680,799円	1,497,153,308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)	3,046,201,666円	2,569,002,069円
計	511,846,743,484円	594,500,161,580円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	511,846,743,484口	594,500,161,580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76,555,839,339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45,960,838,626円であります。

(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	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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。	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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産の売買代金、配当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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月10日現在	平成23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ぬ。	同左
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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(2)デリバティブ取引 同左
	(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 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。	(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月10日現在	平成23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	7,892,139,731	17,711,445,210
合計	7,892,139,731	17,711,445,210

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年9月16日から平成22年11月10日まで、及び平成23年3月16日から平成23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	平成22年11月10日 現在				平成23年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	2,004,276,370	-	2,003,376,533	899,837	259,021,153	-	258,970,013	51,140
アメリカ・ドル	1,705,065,260	-	1,704,231,284	833,976	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	146,149,683	-	146,115,871	33,812
シンガポール・ドル	-	-	-	-	112,871,470	-	112,854,142	17,328
ニュージーランド・ドル	173,355,496	-	173,300,819	54,677	-	-	-	-
ユーロ	125,855,614	-	125,844,430	11,184	-	-	-	-
買 建	2,004,276,370	-	1,992,574,284	11,702,086	2,671,817,153	-	2,667,142,809	4,674,344
アメリカ・ドル	299,211,110	-	300,564,762	1,353,652	2,671,817,153	-	2,667,142,809	4,674,344
オーストラリア・ドル	1,705,065,260	-	1,692,009,522	13,055,738	-	-	-	-
合計	4,008,552,740	-	3,995,950,817	10,802,249	2,930,838,306	-	2,926,112,822	4,623,204

（注） 1. 時価の算定方法

- (1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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。

特定期間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。

特定期間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。

- ・ 特定期間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。
- ・ 特定期間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) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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、特定期間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)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8504円 (8,504円)	0.9227円 (9,227円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	533,947	67,651,084.900	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,060,692	354,275,099.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,341,561	139,441,850.340	
		BIOMED REALTY TRUST INC	858,235	16,632,594.300	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	1,209,743	31,320,246.270	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,313,478	101,205,052.340	
		VORNADO REALTY TRUST	1,466,129	138,974,367.910	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,853,204	168,538,760.280	
		LASALLE HOTEL 7.5 H	250,000	6,127,500.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	6,573,934	114,057,754.900	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1,320,732	31,367,385.000	
		HUDSON PACIFIC PROP B	240,000	6,180,000.000	
		KIMCO REALTY 6.90% H	567,615	14,247,136.500	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	558,023	23,425,805.540	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	752,818	16,486,714.200	
		VENTAS INC	1,503,909	81,978,079.590	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY	1,363,999	22,574,183.450	
		AMB PROPERTY CORP	432,061	15,316,562.450	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	1,848,978	22,539,041.820	
		BRE PROPERTIES-CL A	1,017,732	49,583,903.040	
		MACK-CALI REALTY CORP	1,016,434	35,331,245.840	
		DEVELOPERS DIV REALTY	4,709,372	68,097,519.120	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	177,541	23,794,044.820	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	560,210	48,777,484.700
HEALTH CARE REIT INC	1,461,607	74,805,046.260
HCP INC	1,300,111	48,780,164.720
HOME PROPERTIES INC	825,000	51,075,750.000
KILROY REALTY CORP	768,626	31,160,098.040
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,460,737	50,950,506.560
MACERICH CO/THE	718,626	36,707,416.080
EQUITY LIFESTYLE PROPERTI	667,086	39,351,403.140
NATIONWIDE HEALTH PPTYS	1,200,721	51,258,779.490
PROLOGIS	6,111,327	96,742,306.410
POST PROPERTIES INC	681,219	27,316,881.900
PUBLIC STORAGE	1,191,368	140,152,531.520
REGENCY CENTERS CORP	1,444,256	65,468,124.480
SL GREEN REALTY CORP	437,121	36,337,868.730
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,546,463	36,310,951.240
UDR INC	4,186,029	106,283,276.310
HEALTH CARE REIT 7.875% D	209,434	5,386,642.480
DEVELOP DIV RLTY 7.375% H	375,076	9,369,398.480
SL GREEN REALTY 7.625% C	933,980	23,676,393.000
PS BUSINESS PARK 7% H	166,095	4,160,679.750
PS BUSINESS PARK 6.875% I	175,885	4,361,948.000
DEVELOP DIV RLTY 7.5% I	268,800	6,744,192.000
SL GREEN REALTY 7.875% D	224,176	5,691,828.640
APARTMENT INVEST 8% T	273,900	6,951,582.000
APARTMENT INVEST 7.75% U	879,895	22,261,343.500
DUKE REALTY CORP 6.5% K	401,434	9,710,688.460
EQUITY RES PROP 6.48% N	227,917	5,716,158.360
HCP INC 7.1% F	300,000	7,536,000.000
KIMCO REALTY 6.65% F	210,228	5,253,597.720
PROLOGIS TRUST 6.75% F	327,570	7,907,539.800
WEINGARTEN RLTY 6.75% D	211,985	5,225,430.250
ALEXANDRIA RE EQ 8.375% C	242,635	6,247,851.250
KIMCO REALTY 7.75% G	1,036,887	27,000,537.480
DUKE REALTY CORP 8.375 O	347,129	9,355,126.550
HEALTH CARE REIT 7.625% F	171,969	4,429,921.440
APARTMENT INVEST 8% V	278,447	7,083,691.680
U-STORE-IT TRUST	1,537,072	17,061,499.200
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	2,656,283	26,190,950.380
DIGITAL REALTY TRUST INC	626,825	37,954,253.750
TAUBMAN CENTERS 8% G	304,615	7,718,944.100
FIRST POTOMAC 7.75 A	340,000	8,670,000.000
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,478,745	14,723,745.300
CBL&ASSOC PROP 7.375% D	821,980	20,138,510.000
VORNADO RLTY TST 6.625% G	639,495	15,821,106.300
EDUCATION REALTY TRUST	2,313,169	18,690,405.520
SUNSTONE HOTEL 8% A	208,950	5,058,679.500
CEDAR SHOPPING 8.875% A	260,000	6,497,400.000
DIAMONDROCK HOSPITALITY	2,999,779	32,997,569.000
TAUBMAN CENTERS 7.625% H	173,550	4,373,460.000
REGENCY CENTERS 7.25% D	319,214	8,002,694.980
REGENCY CENTERS 6.7% E	182,038	4,401,678.840
VORNADO REALTY TST 6.75%F	531,527	13,245,652.840
VORNADO REALTY TST 6.75%H	272,040	6,768,355.200
LASALLE HOTEL 8% E	137,366	3,498,712.020
COMMONWEALTH REI 7.125% C	235,161	5,914,299.150
PUBLIC STORAGE 6.95% H	399,372	10,100,117.880
PUBLIC STORAGE INC I	359,399	9,107,170.660

	VORNADO RLTY TST 6.625% I	723,498	17,921,045.460
	PS BUSINESS PARK 7.375% O	306,800	7,762,040.000
	DUKE REALTY CORP 7.25% N	231,529	5,829,900.220
	PUBLIC STORAGE INC -K	345,539	8,831,976.840
	DUKE REALTY CORP 6.60% L	872,066	21,008,069.940
	NAT'L RETAIL PROP CL C	206,879	5,234,038.700
	DOUGLAS EMMETT	2,106,638	41,753,565.160
	PUBLIC STORAGE INC L	571,686	14,572,276.140
	LASALLE HOTEL G	178,500	4,328,625.000
	REALTY INCOME PFD E	60,000	1,510,800.000
	BRE PROPERTIES 6.75 D	279,864	6,968,613.600
	PUBLIC STORAGE INC M	692,581	17,619,260.640
	PS BUSINESS PARK P	506,625	12,645,360.000
	BIOMED REALTY 7.375 A	671,885	16,978,533.950
	WEINGARTEN RLTY F	836,596	20,538,431.800
	WEINGARTEN RLTY E 6.95	290,000	7,235,500.000
	LEXINGTON REALTY D	282,943	6,898,150.340
	HOSPITALITY PROP C	924,762	22,850,869.020
	PUBLIC STORAGE 6.875 O	535,000	13,765,550.000
	EQUITY LIFESTYLE 8.034 A	468,000	11,826,360.000
	HEALTH CARE REIT 6.5 I	88,500	4,650,675.000
	PS BUSINESS PARK 6.875R	280,000	7,000,000.000
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	346,000	8,688,060.000
	DUPONT FABROS 7.625 B	350,000	8,603,000.000
	VORNADO RLTY TST 6.875 J	277,089	6,921,683.220
	PUBLIC STORAGE 6.5 Q	293,209	7,330,225.000
	COMMONWEALTH REIT 6.5% D	1,288,900	28,355,800.000
	PEBBLEBROOK HOTEL 7.875 A	400,000	10,104,000.000
	DUKE REALTY CORP 6.95% M	572,094	14,399,605.980
アメリカ・ドル	小計	104,577,849	アメリカ・ドル 3,313,762,292.660 (266,095,112,101)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	7,965,811	61,018,112.260
	SEGro PLC	19,805,518	63,040,963.790
	HAMMERSON PLC	17,883,180	83,764,815.120
	BRITISH LAND CO PLC	16,274,258	95,936,750.910
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	9,150,413	37,223,880.080
	DERWENT LONDON PLC	2,432,134	42,197,524.900
イギリス・ポンド	小計	73,511,314	イギリス・ポンド 383,182,047.060 (50,457,411,958)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	WESTFIELD RETAIL TRUST	59,150,998	156,750,144.700
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	15,642,700	14,156,643.500
	DEXUS PROPERTY GROUP	108,164,844	92,480,941.620
	GPT GROUP	40,773,687	125,175,219.090
	INVESTA OFFICE FUND	21,033,420	12,830,386.200
	MIRVAC GROUP	47,006,655	55,702,886.170
	STOCKLAND	51,357,952	181,807,150.080
	WESTFIELD GROUP	43,858,948	399,116,426.800
	GOODMAN GROUP	182,327,848	130,364,411.320
オーストラリア・ドル	小計	569,317,052	オーストラリア・ドル 1,168,384,209.480 (101,006,814,910)

カナダ・ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,557,730	カナダ・ドル 39,317,105.200
	DUNDEE REAL ESTATE INVEST	788,996	26,691,734.680
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	1,001,916	48,262,293.720
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	1,840,227	38,092,698.900
カナダ・ドル 小計		5,188,869	カナダ・ドル 152,363,832.500 (12,679,718,140)
シンガポール・ドル	CAPITACOMMERCIAL TRUST	114,777,000	シンガポール・ドル 161,835,570.000
	CAPITAMALL TRUST	50,894,392	96,699,344.800
	SUNTEC REIT	32,058,005	48,087,007.500
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	7,239,000	6,551,295.000
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	36,559,522	75,312,615.320
シンガポール・ドル 小計		241,527,919	シンガポール・ドル 388,485,832.620 (25,305,967,137)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT	1,095,387	ユーロ 11,643,963.810
	CORIO NV	1,940,626	92,043,891.180
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,665,376	247,974,486.400
	GECINA SA	836,681	81,484,362.590
	FONCIERE DES REGIONS	335,500	25,447,675.000
	MERCIALYS	1,223,030	35,498,445.750
ユーロ 小計		7,096,600	ユーロ 494,092,824.730 (56,845,379,485)
香港・ドル	LINK REIT	34,617,324	香港・ドル 841,200,973.200
	CHAMPION REIT	79,696,176	357,835,830.240
香港・ドル 小計		114,313,500	香港・ドル 1,199,036,803.440 (12,386,050,179)
投資証券 合計			524,776,453,910 [524,776,453,910]
合計			524,776,453,910 [524,776,453,910]

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 109銘柄	100%	50.8%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	100%	9.6%
オーストラリア・ドル	投資証券 9銘柄	100%	19.2%
カナダ・ドル	投資証券 4銘柄	100%	2.4%
シンガポール・ドル	投資証券 5銘柄	100%	4.8%
ユーロ	投資証券 6銘柄	100%	10.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	2.4%

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。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23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	150,638,771	208,748,845
投資証券	14,999,302,000	13,608,623,000
未収入金	63,389,357	150,263,285
未収配当金	221,050,319	168,625,384
流動資産合計	15,434,380,447	14,136,260,514
資産合計	15,434,380,447	14,136,260,514
負債の部		
流動負債		
未払金	-	40,660,206
未払解約金	46,640,000	111,500,000
流動負債合計	46,640,000	152,160,206
負債合計	46,640,000	152,160,206
純資産の部		
元本等		
元本	1 16,405,293,773	13,642,301,744
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,017,553,326	341,798,564
元本等合計	15,387,740,447	13,984,100,308
純資産合計	15,387,740,447	13,984,100,308
負債純資産合計	15,434,380,447	14,136,260,514

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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 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。	投資証券 同左
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在

1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	18,262,264,942円	16,405,293,773円
	同期中における追加設定元本額	1,320,674,174円	209,632,771円
	同期中における一部解約元本額	3,177,645,343円	2,972,624,800円
	同期末における元本の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ・5資産国際分散ファンド(適格機関投資家専用)	96,925,383円	-円
	安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	202,887,685円	159,285,512円
	インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	226,861,001円	181,361,646円
	成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	721,989,677円	630,593,359円
	安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	5,357,343円	4,195,566円
	インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	6,004,699円	4,468,888円
	成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	14,452,259円	14,027,703円
	6資産バランスファンド(分配型)	1,562,510,933円	1,195,674,910円
	6資産バランスファンド(成長型)	2,003,407,868円	1,684,678,970円
	ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)	130,111,192円	104,977,111円
	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	1,289,087,690円	814,044,843円
	『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	20,748,378円	16,732,730円
	ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	559,243,514円	471,395,417円
	ダイワ円債重視バランスファンド(奇数月決算型)	1,329,347円	1,086,477円
	ダイワ円債重視バランスファンド(資産形成型)	83,157円	72,851円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	101,951,193円	110,617,387円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	123,282,426円	128,432,923円
	DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	102,843,137円	115,548,317円
	DCダイワJ-REITアクティブファンド	91,509,396円	86,589,782円
	ダイワファンドラップJ-REITセレクト	7,369,527,661円	6,436,671,219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)	472,508,244円	395,698,444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)	176,467,594円	145,931,000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)	920,289,453円	728,650,496円
	ダイワJリート・ファンド	205,914,543円	211,566,193円
	計	16,405,293,773円	13,642,301,744円

2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	16,405,293,773口	13,642,301,744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1,017,553,326円でありませ	

(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	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月10日現在	平成23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	同左
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券	(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。	同左
(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務	(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月10日現在	平成23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	349,232,997	801,975,026
合計	349,232,997	801,975,026

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年5月11日から平成22年11月10日まで、及び平成22年11月11日から平成23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

平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9380円 (9,380円)	1.0251円 (10,251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	日本アコモデーションファンド投資法人	690	407,790,000	
	M I Dリート投資法人	1,000	248,000,000	
	森ヒルズリート	1,200	326,760,000	
	野村不レジデンシャル	600	296,400,000	
	産業ファンド	319	136,213,000	
	アドバンス・レジデンス	4,200	691,320,000	
	日本ビルファンド	2,250	1,847,250,000	
	ジャパンリアルエステイト	1,900	1,518,100,000	
	日本リテールファンド	7,100	925,840,000	
	オリックス不動産投資	800	339,600,000	
	日本プライムリアルティ	2,500	579,250,000	

プレミア投資法人	400	151,600,000	
東急リアル・エステート	450	244,350,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	610	429,440,000	
野村不動産オフィスF	1,400	781,200,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,000	623,400,000	
森トラスト総合リート	1,100	899,800,000	
フロンティア不動産投資	800	600,000,000	
平和不動産リート	3,200	169,920,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	400	275,200,000	
福岡リート投資法人	414	248,400,000	
ケネディクス不動産投資法人	850	294,525,000	
積水ハウス・S I 投資法人	370	134,125,000	
大和証券オフィス投資法人	1,400	393,540,000	
ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	550	100,650,000	
トップリート投資法人	550	267,300,000	
ビ・ライフ投資法人	500	295,000,000	
日本賃貸住宅投資法人	4,000	140,000,000	
ジャパンエクセレント投資法人	550	243,650,000	
投資証券 合計	46,103	13,608,623,000	
合計	46,103	13,608,623,000	

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。

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。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	52,580,153	79,357,951
コール・ローン	26,843,506	24,021,563
株式	2,257,925,036	2,080,051,489
ハイブリッド優先証券	667,199,979	629,118,669
投資証券	63,302,543	67,498,525
派生商品評価勘定	-	78,750
未収入金	21,408,154	11,563,385
未収配当金	3,460,945	1,653,793
未収利息	2,063,697	618,963
流動資産合計	3,094,784,013	2,893,963,088
資産合計	3,094,784,013	2,893,963,088
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	155,000	-
未払金	652,502	19,049,811
未払解約金	19,000,000	12,500,000
流動負債合計	19,807,502	31,549,811
負債合計	19,807,502	31,549,811
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,652,425,964	3,141,443,545
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 577,449,453	279,030,268
元本等合計	3,074,976,511	2,862,413,277
純資産合計	3,074,976,511	2,862,413,277
負債純資産合計	3,094,784,013	2,893,963,088

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2) ハイブリッド優先証券	(1) 株式 同左 (2) ハイブリッド優先証券

	<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>	同左
	<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>	(3)投資証券 同左
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	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、原則として本報告書における開示対象ファンドの特定期間末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>	同左
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金	(1)受取配当金
	<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>	同左
	(2)受取利息	(2)受取利息
	<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>	同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

	<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。</p>	同左
--	--	----

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,844,680,180円	3,652,425,964円
同期中における追加設定元本額	49,139,533円	26,464,282円
同期中における一部解約元本額	241,393,749円	537,446,701円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド（適格機関投資家専用）	32,590,888円	- 円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド(毎月分配型)	419,921,802円	346,344,619円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	146,121,635円	109,678,179円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	169,143,594円	120,256,556円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	1,892,810,430円	1,655,718,542円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,464,796円	3,070,159円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	4,201,498円	3,249,402円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	42,355,003円	36,760,771円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	311,244,732円	279,427,543円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	422,609,146円	355,692,779円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	43,802,438円	48,606,062円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	78,902,258円	85,789,742円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	85,257,744円	96,849,191円
計	3,652,425,964円	3,141,443,545円

2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	3,652,425,964口	3,141,443,545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577,449,453円でありませす。	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279,030,268円でありませす。

(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 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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。	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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産の売買代金、配当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。	同左

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。	同左
----------------------------	--	----

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月10日現在	平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成22年11月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	平成23年5月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
	株式	66,906,258
ハイブリッド優先証券	554,286	6,810,085
投資証券	269,084	1,087,949
合計	66,621,056	67,025,762

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成22年10月16日から平成22年11月10日まで、及び平成23年4月16日から平成23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	平成22年11月10日 現在				平成23年5月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	20,287,500	-	20,442,500	155,000	20,151,250	-	20,072,500	78,750
アメリカ・ドル	20,287,500	-	20,442,500	155,000	20,151,250	-	20,072,500	78,750
合計	20,287,500	-	20,442,500	155,000	20,151,250	-	20,072,500	78,750

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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。

特定期間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。

特定期間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。

- ・ 特定期間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。
- ・ 特定期間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) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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、特定期間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)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8419円 (8,419円)	0.9112円 (9,112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 LABS	9,200	52.660	484,472.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	2,200	85.550	188,210.000	
	CITIGROUP INC	6,940	44.160	306,470.400	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,400	53.920	129,408.000	
	COVIDIEN PLC	7,400	55.440	410,256.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,100	34.110	242,181.000	
	PEABODY ENERGY CORP	3,100	63.900	198,090.000	
	BECTON DICKINSON & CO	3,200	86.950	278,240.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON	8,800	28.570	251,416.000	
JPMORGAN CHASE & CO	15,100	44.960	678,896.000		

CORNING INC	18,000	20.830	374,940.000
DOW CHEMICAL	7,300	39.850	290,905.000
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	2,000	35.460	70,920.000
COSTCO WHOLESALE CORP	4,400	81.400	358,160.000
FRANKLIN RESOURCES INC	1,100	127.140	139,854.000
EXXON MOBIL CORP	8,000	83.180	665,440.000
NEXTERA ENERGY INC	2,800	57.650	161,420.000
FREEMONT-MCMORAN COPPER	2,700	51.880	140,076.000
US BANCORP	10,800	25.250	272,700.000
GENERAL ELECTRIC CO	29,900	20.070	600,093.000
GENERAL DYNAMICS CORP	3,500	74.570	260,995.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,600	149.120	238,592.000
HARRIS CORP	8,700	48.650	423,255.000
HALLIBURTON CO	5,700	48.060	273,942.000
HOME DEPOT INC	3,400	36.960	125,664.000
HUNTINGTON INGALLS INDUST	816	39.600	32,313.600
HEWLETT-PACKARD CO	6,000	41.020	246,120.000
INT'L BUSINESS MACHINES	1,900	169.100	321,290.000
JOHNSON & JOHNSON	4,400	65.630	288,772.000
MCDONALD'S CORP	6,600	79.310	523,446.000
MERCK & CO INC	10,700	36.480	390,336.000
NIKE INC -CL B	1,600	82.910	132,656.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,900	64.810	317,569.000
NEWMONT MINIG CORP	3,300	54.680	180,444.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	6,000	68.290	409,740.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	4,600	107.480	494,408.000
PATTERSON COS INC	8,200	35.540	291,428.000
PG & E CORPORATION	5,900	45.670	269,453.000
PFIZER INC	10,800	20.600	222,480.000
PROCTER & GAMBLE CO	4,300	65.140	280,102.000
CONOCOPHILLIPS	5,400	73.720	398,088.000
PEPSICO INC	2,100	69.820	146,622.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	7,300	63.830	465,959.000
ACCENTURE LTD-CL A	2,500	55.740	139,350.000
QUALCOMM INC	10,600	56.660	600,596.000
ROSS STORES INC	4,400	78.580	345,752.000
CHEVRON CORP	7,100	104.090	739,039.000
SYMANTEC CORP	18,700	19.400	362,780.000
SCHLUMBERGER LTD	1,500	83.590	125,385.000
AT&T INC	12,200	31.350	382,470.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,200	35.340	395,808.000
TIME WARNER CABLE	2,800	76.990	215,572.000
MARATHON OIL CORP	2,500	52.190	130,475.000
UNITED TECHNOLOGIES	3,800	89.520	340,176.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	3,400	73.700	250,580.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,100	50.470	459,277.000
THE WALT DISNEY CO.	7,700	43.100	331,870.000
WELLS FARGO & CO	6,300	28.210	177,723.000
WASTE MANAGEMENT INC	6,800	38.800	263,840.000
WAL-MART STORES	2,600	55.100	143,260.000
WISCONSIN ENERGY CORP	8,400	31.320	263,088.000
VISA INC-CLASS A SHS	6,900	79.860	551,034.000
ORACLE CORPORATION	22,800	35.200	802,560.000
BANK OF AMERICA CORP	19,600	12.180	238,728.000
NORDSTROM INC	7,600	47.310	359,556.000
AMERICAN EXPRESS CO	5,500	50.190	276,045.000
AMGEN	2,300	57.690	132,687.000

	EATON CORP	5,000	51.760	258,800.000
	ECOLAB INC	3,700	52.470	194,139.000
	BAXTER INTL INC	2,700	58.920	159,084.000
	CHUBB CORP	4,200	65.300	274,260.000
	INTEL CORP	6,500	22.760	147,940.000
	JOHNSON CONTROLS INC	9,400	39.740	373,556.000
	MICROSOFT CORP	10,000	25.830	258,300.000
	CVS CAREMARK CORP	15,100	37.480	565,948.000
	APACHE CORP	3,600	127.330	458,388.000
	CARNIVAL CORP	3,100	39.610	122,791.000
アメリカ・ドル 小計		株 519,756		アメリカ・ドル 23,816,679.000 (1,912,479,324)
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
	SUNCOR ENERGY INC	5,400	40.610	219,294.000
	TORONTO-DOMINION BANK	2,200	82.210	180,862.000
	ROYAL BANK OF CANADA	3,100	58.900	182,590.000
	TRANSCANADA CORP	3,600	41.380	148,968.000
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	1,200	52.580	63,096.000
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	8,800	35.620	313,456.000
	POWER CORP OF CANADA	9,000	27.760	249,840.000
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,400	74.350	252,790.000
	FINNING INTERNATIONAL INC	4,849	26.520	128,595.480
	TIM HORTONS INC	5,700	48.090	274,113.000
カナダ・ドル 小計		株 47,249		カナダ・ドル 2,013,604.480 (167,572,165)
合計		株 567,005		2,080,051,489 [2,080,051,489]

(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	
		NATL CITY CAP III 6.625	4,700.000	120,132.000	
		COMCAST 6.625	10,118.000	260,740.860	
		DOMINION RES A 8.375	4,000.000	115,320.000	
		TELEPHONE & DATA 6.875	5,375.000	134,482.500	
		SEASPAN CORPORATION 9.5	2,177.000	62,479.900	
		ALLY FINANCIAL 7.375	4,499.000	109,865.580	
		ALLY FINANCIAL 7.3	3,500.000	85,645.000	
		FIFTH THIRD CAP VI	14,028.000	359,818.200	
		MONTPELIER RE 8.875	3,000.000	75,720.000	
		SCANA CORP A 7.7	4,100.000	116,440.000	
		REGIONS FIN TR III 8.875	5,414.000	143,579.280	
		KEYCORP CAP TR X 8.0	3,700.000	96,755.000	
		COUNTRYWIDE CAP IV 6.75	8,300.000	205,840.000	
		METLIFE B 6.500	7,400.000	187,812.000	
		WR BERKLEY CP II 6.75	6,489.000	161,511.210	
		TELEPHONE&DATASYS 6.625	7,025.000	174,220.000	
		BGE CAPITAL TR II 6.200	7,463.000	187,097.410	
		FLEET CAP TR VIII 7.200	5,000.000	126,500.000	
		FPC CAPITAL I 7.100	9,425.000	242,976.500	
		PARTNERRE C 6.750	2,633.000	65,719.680	
		PINCIPAL FINL GRP 6.518	2,600.000	65,078.000	
		CITIGROUP CAP VIII 6.95	16,500.000	414,150.000	
		USB CAPITAL X 6.5	1,500.000	37,875.000	

		LINCOLN NATL CP G 6.75%	9,500.000	238,355.000
		CAPITAL ONE CAP II 7.50	9,775.000	252,879.250
		KEYCORP CAP VIII 7.00%	4,885.000	124,469.800
		CITIGROUP CAP XIV 6.875	3,700.000	92,389.000
		PPL ENERGY SUPPLY 7.00	3,500.000	89,320.000
		USB CAPITAL XI 6.600	3,500.000	89,285.000
		MORGAN S CP TR VII 6.60	14,800.000	364,080.000
		ARCH CAPITAL GR B 7.875	8,000.000	201,840.000
		COUNTRYWIDE CAP V 7.00%	10,000.000	249,100.000
		NAT'L CITY CP TR II 6.6	4,721.000	120,810.390
		KEYCORP CAP IX	14,301.000	359,670.150
		VIACOM 6.850	5,000.000	128,500.000
		CITIGROUP CAP XVI 6.45	3,120.000	76,159.200
		CBS 6.750	10,000.000	254,200.000
		JPMCHASE CAP XXIX 6.7	16,575.000	432,939.000
		WACHOVIA CAP X 7.850	2,775.000	73,676.250
		WELLS F CAP J 8.0	11,100.000	321,456.000
		BANK OF AMERICA H 8.20	2,500.000	65,025.000
		AIG 7.70 A-5	12,000.000	303,960.000
		CITIGROUP CAP XIII 7.875	5,000.000	139,600.000
		AMER FINL GROUP 7.0	7,944.000	202,651.440
		GMAC CAP TRUST I VAR	4,000.000	104,480.000
	アメリカ・ドル 小計		305,642.000	アメリカ・ドル 7,834,603.600 (629,118,669)
ハイブリッド優先証券 合計			305,642.000	629,118,669 [629,118,669]
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル
		LEXINGTON REALTY 6.5 C	1,800	85,824.000
		COUSINS PROPERTY 7.75% A	5,400	134,568.000
		DEVELOP DIV RLTY 7.5% I	5,472	137,292.480
		APARTMENT INVEST 8% V	5,000	127,200.000
		CBL&ASSOC PROP 7.375% D	6,000	147,000.000
		CORP OFFICE PROPS J	3,100	77,872.000
		BIOMED REALTY 7.375 A	2,196	55,492.920
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,000	75,330.000
	アメリカ・ドル 小計		31,968	アメリカ・ドル 840,579.400 (67,498,525)
投資証券 合計				67,498,525 [67,498,525]
合計				696,617,194 [696,617,194]

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 77銘柄 ハイブリッド 45銘柄 優先証券 投資証券 8銘柄	73.3%	24.1%	2.6%	94.0%

カナダ・ドル	株式	10銘柄	100%	-%	-%	6.0%
--------	----	------	------	----	----	------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	40,236,592	-
コール・ローン	29,805,804	58,209,190
株式	2,911,524,248	2,656,702,610
派生商品評価勘定	115,558	-
未収入金	53,231,978	44,113,950
未収配当金	2,391,953	9,470,483
流動資産合計	3,037,306,133	2,768,496,233
資産合計	3,037,306,133	2,768,496,233
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,793	-
前受金	-	1,389,453
未払金	32,121,723	-
未払解約金	18,500,000	41,450,000
流動負債合計	50,684,516	42,839,453
負債合計	50,684,516	42,839,453
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,620,337,579	3,120,471,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 633,715,962	394,814,788
元本等合計	2,986,621,617	2,725,656,780
純資産合計	2,986,621,617	2,725,656,780
負債純資産合計	3,037,306,133	2,768,496,233

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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、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。	株式 同左
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	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,990,436,415円	3,620,337,579円
同期中における追加設定元本額	76,055,009円	13,430,279円
同期中における一部解約元本額	446,153,845円	513,296,290円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド （適格機関投資家専用）	33,095,224円	- 円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド （毎月分配型）	423,645,405円	356,127,437円
安定重視ポートフォリオ（奇数月 分配型）	161,387,848円	115,427,756円

インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	173,567,162円	126,552,456円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,919,357,088円	1,696,900,497円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	4,005,018円	3,148,884円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	4,471,042円	3,474,890円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	43,151,959円	37,614,753円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	314,138,251円	287,680,055円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	424,727,942円	364,471,515円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	25,187,056円	26,343,928円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	45,178,122円	47,733,769円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	48,425,462円	54,995,628円
計	3,620,337,579円	3,120,471,568円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	3,620,337,579口	3,120,471,568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633,715,962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394,814,788円であり ます。

(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	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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。	同左

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>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、配当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>	同左
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>	<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>

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月10日現在	平成23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	<p>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。</p>	同左
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</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

	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。	同左
--	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月10日現在	平成23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	57,983,703	1,033,243
合計	57,983,703	1,033,243

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年10月16日から平成22年11月10日まで、及び平成23年4月16日から平成23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	平成22年11月10日 現在				平成23年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	71,142,221	-	71,105,111	37,110	-	-	-	-
イギリス・ポ ンド	10,038,611	-	10,037,844	767	-	-	-	-
スイス・フラ ン	6,167,639	-	6,166,908	731	-	-	-	-
スウェーデン ・ クローナ	5,072,177	-	5,070,707	1,470	-	-	-	-
ユーロ	49,863,794	-	49,829,652	34,142	-	-	-	-
買 建	48,616,221	-	48,631,876	15,655	-	-	-	-
スイス・フラ ン	6,472,057	-	6,520,055	47,998	-	-	-	-
ノルウェー・ ク ローネ	20,865,737	-	20,892,799	27,062	-	-	-	-
ユーロ	21,278,427	-	21,219,022	59,405	-	-	-	-
合計	119,758,442	-	119,736,987	52,765	-	-	-	-

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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。

特定期間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。

特定期間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。

- ・ 特定期間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。
 - ・ 特定期間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) 本報告書における開示対象ファンドの特定期間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、特定期間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)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8250円 (8,250円)	0.8735円 (8,735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	
	BP PLC	96,437	4.545	438,306.160	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	21,548	6.315	136,075.620	
	ROLLS-ROYCE GROUP-C SHRS	2,109,984	0.001	2,109.980	
	REXAM PLC	96,897	3.898	377,704.500	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	13,247	13.035	172,674.640	
	RIO TINTO PLC-REG	8,602	41.355	355,735.710	
	PEARSON PLC	38,146	11.360	433,338.560	
	VODAFONE GROUP PLC	418,262	1.701	711,463.660	
	KINGFISHER PLC	144,502	2.755	398,103.010	
	RECKITT BENCKISER PLC	10,300	34.460	354,938.000	
	NATIONAL GRID PLC	63,058	6.145	387,491.410	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	22,932	26.700	612,284.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	131,907	6.482	855,021.170	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	40,508	21.970	889,960.760		
イギリス・ポンド 小計		株 3,216,330		イギリス・ポンド 6,125,207.580 (806,567,334)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	2,435	143.900	350,396.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	27,568	53.950	1,487,293.600	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	18,760	36.990	693,932.400	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	2,400	231.300	555,120.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	20,301	52.700	1,069,862.700	
	GIVAUDAN REG	567	940.000	532,980.000	
HOLCIM LTD-REG	7,581	69.900	529,911.900		
スイス・フラン 小計		株 79,612		スイス・フラン 5,219,497.100 (480,245,928)	
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	

	NORDEA AB	29,352	68.800	2,019,417.600
	HENNES & MAURITZ AB-B	20,943	228.200	4,779,192.600
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	38,998	96.050	3,745,757.900
	SKANSKA AB-B	22,886	121.200	2,773,783.200
	ATLAS COPCO AB-B SHS	22,986	153.800	3,535,246.800
スウェーデン・クローナ 小計	株	135,165		スウェーデン・クローナ 16,853,398.100 (215,892,029)
ノルウェー・クローネ	株		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	DNB NOR ASA	27,081	80.800	2,188,144.800
ノルウェー・クローネ 小計	株	27,081		ノルウェー・クローネ 2,188,144.800 (31,968,795)
ユーロ	株		ユーロ	ユーロ
	SIEMENS AG	6,594	94.860	625,506.840
	E.ON AG	6,755	21.200	143,206.000
	BASF SE	8,538	65.640	560,434.320
	ALLIANZ SE-REG	6,136	99.450	610,225.200
	MUNCHENER RUECK AG-REG	2,191	110.100	241,229.100
	DAIMLER AG	4,935	50.700	250,204.500
	PHILIPS ELECTRONICS NV	23,098	20.305	469,004.890
	AHOLD (KONINKLIJKE) NV	47,577	9.564	455,026.420
	AKZO NOBEL	8,414	52.040	437,864.560
	TOTAL SA	15,159	41.270	625,611.930
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	4,089	114.500	468,190.500
	BNP PARIBAS	14,935	52.940	790,658.900
	VIVENDI SA	13,024	18.910	246,283.840
	SOCIETE GENERALE-A	10,539	42.185	444,587.710
	FRANCE TELECOM SA	13,455	15.580	209,628.900
	SANOFI-AVENTIS	13,020	54.960	715,579.200
	GDF SUEZ	20,065	26.095	523,596.170
	BELGACOM SA	6,296	24.995	157,368.520
	TELEFONICA S.A.	26,469	16.930	448,120.170
	REPSOL YPF SA	18,436	22.845	421,170.420
	BANCO SANTANDER SA	65,669	8.050	528,635.450
	OESTERREICHISCHE POST	15,590	24.400	380,396.000
ユーロ 小計	株	350,984		ユーロ 9,752,529.540 (1,122,028,524)
合計	株	3,809,172		2,656,702,610 [2,656,702,610]

(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 14銘柄	100%	30.4%
スイス・フラン	株式 7銘柄	100%	18.1%
スウェーデン・クローナ	株式 5銘柄	100%	8.1%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.2%
ユーロ	株式 22銘柄	100%	42.2%

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。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	27,840,048	12,910,788
コール・ローン	49,987,229	46,596,248
株式	2,905,736,720	2,604,501,102
未収入金	-	36,099,520
未収配当金	5,993,216	5,228,744
流動資産合計	2,989,557,213	2,705,336,402
資産合計	2,989,557,213	2,705,336,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,000,000	36,200,000
流動負債合計	26,000,000	36,200,000
負債合計	26,000,000	36,200,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,428,241,234	1,998,126,961
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	535,315,979	671,009,441
元本等合計	2,963,557,213	2,669,136,402
純資産合計	2,963,557,213	2,669,136,402
負債純資産合計	2,989,557,213	2,705,336,402

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23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、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。	株式 同左
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	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,707,824,893円	2,428,241,234円
同期中における追加設定元本額	55,344,587円	717,205円
同期中における一部解約元本額	334,928,246円	430,831,478円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド （適格機関投資家専用）	24,633,925円	- 円
ダイワ・グローバル好配当株ファンド （毎月分配型）	291,927,093円	235,696,532円
安定重視ポートフォリオ（奇数月 分配型）	110,295,451円	77,879,226円

インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	116,217,321円	88,457,012円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,321,731,538円	1,123,921,581円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	2,621,759円	2,131,071円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	3,100,202円	2,286,685円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	29,753,363円	24,694,631円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	217,860,840円	186,793,056円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	293,749,042円	239,916,467円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	3,418,599円	3,418,599円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	6,323,033円	6,323,033円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	6,609,068円	6,609,068円
計	2,428,241,234円	1,998,126,961円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	2,428,241,234口	1,998,126,961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	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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。	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であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産の売買代金、配当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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年11月10日現在	平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成22年11月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	平成23年5月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	64,890,657	21,955,803
合計	64,890,657	21,955,803

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間(平成22年10月16日から平成22年11月10日まで、及び平成23年4月16日から平成23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

平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在

本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2205円 (12,205円)	1.3358円 (13,358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 BILLITON LTD	53,000	44.750	2,371,750.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	8,000	45.850	366,800.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	13,200	27.840	367,488.000	
	WESTPAC BANKING	10,000	24.060	240,600.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	75,000	23.390	1,754,250.000	
	RIO TINTO LTD	10,000	80.010	800,100.000	
	ADELAIDE BRIGHTON LIMITED	102,000	3.120	318,240.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	30,000	52.650	1,579,500.000	
	ORICA LIMITED	26,500	26.300	696,950.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	25,000	11.970	299,250.000	
	TELSTRA CORPORATION	40,000	2.930	117,200.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	5,000	34.750	173,750.000	
	CSL LIMITED	16,000	34.580	553,280.000	
	ONESTEEL LIMITED	40,000	2.130	85,200.000	
	WESFARMERS LIMITED	32,000	33.480	1,071,360.000	
	SUNCORP GROUP LTD	40,000	8.060	322,400.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,000	9.460	208,120.000	
	JB HI-FI LTD	34,000	19.000	646,000.000	
WOTIF.COM HOLDINGS LTD	20,000	5.500	110,000.000		
オーストラリア・ドル 小計		株 601,700		オーストラリア・ドル 12,082,238.000 (1,044,509,475)	
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	
	UNITED OVERSEAS BANK	45,000	18.980	854,100.000	
	STRAITS ASIA RESOURCES LT	50,000	2.880	144,000.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,000	14.460	347,040.000	
	KEPPEL CORP	27,500	11.500	316,250.000	
	CAPITALAND LIMITED	60,000	3.230	193,800.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	40,000	5.580	223,200.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	10,000	36.640	366,400.000	
	SINGAPORE TELECOM	60,000	3.100	186,000.000	
NOBLE GROUP LTD	100,909	2.100	211,908.900		
シンガポール・ドル 小計		株 417,409		シンガポール・ドル 2,842,698.900 (185,173,406)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SAMSUNG C&T CORP	3,500	76,800.000	268,800,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	5,400	238,500.000	1,287,900,000.000	
	GS ENGINEERING&CONSTRUCT	5,000	119,000.000	595,000,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,200	482,500.000	579,000,000.000	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LT	3,000	224,000.000	672,000,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	15,000	13,800.000	207,000,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH	1,000	402,500.000	402,500,000.000		

	LG CHEMICAL LTD	2,300	505,000.000	1,161,500,000.000
	SAMSUNG ELECTRONICS	2,150	891,000.000	1,915,650,000.000
	KOREA EXCHANGE BANK	30,000	9,150.000	274,500,000.000
	HANA FINANCIAL GROUP	12,500	43,100.000	538,750,000.000
韓国・ウォン 小計		株 81,050		韓国・ウォン 7,902,600,000.000 (587,953,440)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	CHEUNG KONG	40,000	119.400	4,776,000.000
	CLP HOLDINGS LIMITED	30,000	64.050	1,921,500.000
	HUTCHISON WHAMPOA	40,000	89.100	3,564,000.000
	HANG SENG BANK	17,000	121.600	2,067,200.000
	HONG KONG EX & CL	20,000	174.700	3,494,000.000
	LI & FUNG LTD	70,000	36.750	2,572,500.000
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	70,000	34.450	2,411,500.000
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	43,000	106.000	4,558,000.000
	IND & COMM BK OF CHINA-H	420,000	6.450	2,709,000.000
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	55,000	26.850	1,476,750.000	
香港・ドル 小計		株 805,000		香港・ドル 29,550,450.000 (305,256,149)
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル
	CHINA STEEL CORP	458,948	35.050	16,086,127.400
	DELTA ELECTRONICS INC	80,000	133.500	10,680,000.000
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	72,000	91.900	6,616,800.000
	TRANSCEND INFORMATION INC	60,000	83.500	5,010,000.000
	HTC CORPORATION	26,250	1,210.000	31,762,500.000
	FUBON FINANCIAL HOLDING	314,983	42.400	13,355,279.200
	CHINATRUST FINANCIAL HOLD	638,400	26.700	17,045,280.000
	NOVATEK MICROELECTRONICS	30,000	89.400	2,682,000.000
	WISTRON CORP	105,034	51.700	5,430,257.800
	WPG HOLDINGS CO LTD	117,992	55.200	6,513,158.400
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	632,149	75.500	47,727,249.500
FAR EASTERN NEW CENTURY	183,600	46.200	8,482,320.000	
台湾・ドル 小計		株 2,719,356		台湾・ドル 171,390,972.300 (481,608,632)
合計		株 4,624,515		2,604,501,102 [2,604,501,102]

(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 19銘柄	100%	40.1%
シンガポール・ドル	株式 9銘柄	100%	7.1%
韓国・ウォン	株式 11銘柄	100%	22.6%
香港・ドル	株式 10銘柄	100%	11.7%
台湾・ドル	株式 12銘柄	100%	18.5%

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。

[次へ](#)

「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

	平成22年11月10日現在	平成23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	266,663,803	705,025,547
株式	23,971,888,180	25,468,763,000
投資証券	884,380,600	261,847,400
派生商品評価勘定	-	31,320,502
未収入金	288,958,441	350,393,430
未収配当金	275,316,048	405,922,842
差入委託証拠金	-	41,850,000
流動資産合計	25,687,207,072	27,265,122,721
資産合計	25,687,207,072	27,265,122,721
負債の部		
流動負債		
前受金	-	30,700,000
未払金	406,932,098	34,238,840
未払解約金	41,000,000	48,100,000
流動負債合計	447,932,098	113,038,840
負債合計	447,932,098	113,038,840
純資産の部		
元本等		
元本	1 26,041,885,873	25,290,227,624
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 802,610,899	1,861,856,257
元本等合計	25,239,274,974	27,152,083,881
純資産合計	25,239,274,974	27,152,083,881
負債純資産合計	25,687,207,072	27,265,122,721

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	自 平成22年11月11日 至 平成23年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。 (2) 投資証券	(1) 株式 同左 (2) 投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法		先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び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。	受取配当金 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,234,518,416円	26,041,885,873円
同期中における追加設定元本額	1,571,648,622円	3,303,537,467円
同期中における一部解約元本額	1,764,281,165円	4,055,195,716円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・5資産国際分散ファンド (適格機関投資家専用)	81,394,093円	- 円
ダイワ好配当日本株投信Q (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	3,558,867,531円	5,603,218,539円
ダイワ好配当日本株投信(季節点 描)	14,042,346,650円	12,488,222,512円
ダイワ・バランス2資産(外債・ 好配当日本株)(毎月分配型)	40,109,054円	35,532,198円
ダイワ・バランス3資産(外債・ 海外リート・好配当日本株)	134,374,315円	116,123,297円
安定重視ポートフォリオ(奇数月 分配型)	369,146,571円	314,286,433円
インカム重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	437,007,544円	363,693,043円
成長重視ポートフォリオ(奇数月 分配型)	5,025,801,405円	4,321,590,563円
安定重視ポートフォリオ(資産形 成型)	9,572,341円	8,187,045円
インカム重視ポートフォリオ(資 産形成型)	10,996,184円	9,180,561円
成長重視ポートフォリオ(資産形 成型)	111,682,748円	97,751,629円

ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	806,220,412円	754,979,292円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,102,676,551円	842,958,791円
ダイワ円債重視バランスファンド(奇数月決算型)	1,095,294円	982,988円
ダイワ円債重視バランスファンド(資産形成型)	70,685円	70,685円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	64,653,245円	70,724,091円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	118,432,693円	123,217,062円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	127,438,557円	139,508,895円
計	26,041,885,873円	25,290,227,624円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	26,041,885,873口	25,290,227,624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802,610,899円でありません。	

(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	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。	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、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における株価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。	同左
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	平成22年11月10日現在	平成23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ぬ。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (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 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	平成23年5月10日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	743,451,347	432,902,735
投資証券	14,346,800	1,222,200
合計	757,798,147	434,124,935

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年10月16日から平成22年11月10日まで、及び平成23年4月16日から平成23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

株式関連

種類	平成22年11月10日 現在				平成23年5月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	-	-	-	-	588,050,000	-	619,550,000	31,500,000
合計	-	-	-	-	588,050,000	-	619,550,000	31,500,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価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。

原則として本報告書における開示対象ファンドの特定期間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、特定期間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. 株価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)

	平成22年11月10日現在	平成23年5月10日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9692円 (9,692円)	1.0736円 (10,736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	
日鉄鉱業	330,000	366	120,780,000	
三井松島	820,000	185	151,700,000	
太平工業	450,000	344	154,800,000	
田辺工業	149,000	590	87,910,000	
東鉄工業	232,000	724	167,968,000	
大東建託	43,000	6,790	291,970,000	
新日本建設	907,500	249	225,967,500	
高田工業所	178,500	320	57,120,000	
高橋カーテンウォール	189,000	141	26,649,000	
シイエム・シイ	19,400	1,712	33,212,800	
スタジオアリス	228,000	880	200,640,000	
KG情報	51,000	371	18,921,000	
不二製油	114,000	1,164	132,696,000	
ローソン	44,000	3,990	175,560,000	
セリア	939	212,800	199,819,200	
サッポロドラッグストアー	154	148,000	22,792,000	

あい ホールディングス	70,000	334	23,380,000
サイバー	99,900	448	44,755,200
UKCホールディングス	216,700	848	183,761,600
アゼアス	3,600	644	2,318,400
クリヤマ	224,200	485	108,737,000
日本バイリ - ン	104,000	377	39,208,000
MINORIソリューションズ	9,300	548	5,096,400
AQインタラクティブ	990	115,700	114,543,000
トーモク	585,000	220	128,700,000
テイカ	190,000	315	59,850,000
日本化学産業	214,000	641	137,174,000
日本ピグメント	419,000	274	114,806,000
大阪有機化学	264,700	431	114,085,700
タキロン	443,000	315	139,545,000
サンエー化研	157,100	395	62,054,500
ハリマ化成	139,300	545	75,918,500
武田薬品	90,000	3,900	351,000,000
中外製薬	55,000	1,332	73,260,000
エーザイ	181,000	2,975	538,475,000
太陽ホールディングス	34,000	2,498	84,932,000
東洋インキSCホールディン	385,000	405	155,925,000
T&K TOKA	167,700	980	164,346,000
秀英予備校	210,000	309	64,890,000
ラウンドワン	750,000	483	362,250,000
インフォメーションディベロ	18,500	529	9,786,500
日本ハウズイング	55,100	1,430	78,793,000
電通国際情報S	258,100	556	143,503,600
ケミプロ化成	11,000	155	1,705,000
綜研化学	88,100	876	77,175,600
荏原ユーヅライト	53,400	2,585	138,039,000
東燃ゼネラル石油	141,000	1,002	141,282,000
出光興産	17,300	9,280	160,544,000
JXホールディングス	195,000	555	108,225,000
西川ゴム工業	63,000	881	55,503,000
フコク	186,900	707	132,138,300
旭硝子	165,000	1,029	169,785,000
日本ヒューム	553,000	360	199,080,000
東京鐵鋼	605,000	242	146,410,000
住友鋼管	128,000	587	75,136,000
モリ工業	384,000	343	131,712,000
川金ホールディングス	286,500	300	85,950,000
日本精線	380,000	412	156,560,000
タツタ電線	760,000	396	300,960,000
オーナンバ	275,300	913	251,348,900
ホッカンホールディングス	45,000	239	10,755,000
川岸工業	697,000	260	181,220,000
那須電機	397,000	362	143,714,000
高田機工	59,000	218	12,862,000
ダイニチ工業	63,100	664	41,898,400
日東精工	52,000	227	11,804,000
岡部	290,000	453	131,370,000
ジーテクト	68,600	1,570	107,702,000
パイオラックス	178,100	1,813	322,895,300
エイチワン	89,400	617	55,159,800
阪神内燃機	396,000	182	72,072,000

富士機械製造	63,300	1,860	117,738,000
森精機製作所	90,000	1,071	96,390,000
オカダアイヨン	383,000	255	97,665,000
フロイント産業	204,400	405	82,782,000
シンニッタン	651,600	390	254,124,000
住友精密	112,000	670	75,040,000
理想科学工業	246,400	1,398	344,467,200
ブラザー工業	90,000	1,140	102,600,000
東亜バルブエンジニア	42,800	1,573	67,324,400
日本ピラ - 工業	499,000	773	385,727,000
中北製作所	66,000	550	36,300,000
日立	260,000	452	117,520,000
富士電機	1,020,000	249	253,980,000
山洋電気	240,000	659	158,160,000
愛知電機	962,000	325	312,650,000
M C J	26,340	17,080	449,887,200
T D K	69,000	4,225	291,525,000
スミダコーポレーション	127,000	764	97,028,000
三社電機製作所	363,000	693	251,559,000
オーデリック	18,300	1,540	28,182,000
フェローテック	170,000	1,943	330,310,000
ジオマテック	86,700	1,242	107,681,400
岡谷電機	185,200	460	85,192,000
ファナック	20,500	13,110	268,755,000
芝浦電子	78,600	1,399	109,961,400
大真空	32,000	459	14,688,000
日東電工	96,000	4,380	420,480,000
K O A	28,000	888	24,864,000
ニッチツ	630,000	228	143,640,000
日産自動車	210,000	769	161,490,000
トヨタ自動車	131,000	3,250	425,750,000
G M B	165,300	1,370	226,461,000
自動車部品	552,000	405	223,560,000
東京ラチエ - タ -	491,400	514	252,579,600
今仙電機製作所	161,100	1,034	166,577,400
本田技研	217,000	3,065	665,105,000
T B K	594,000	400	237,600,000
ハイレックスコーポレーション	50,000	1,310	65,500,000
日本プラスト	136,700	615	84,070,500
村上開明堂	283,000	1,025	290,075,000
ヨロズ	18,000	1,579	28,422,000
フジオーゼックス	180,000	342	61,560,000
伯東	224,700	839	188,523,300
ヒマラヤ	38,000	508	19,304,000
コーナン商事	133,000	1,305	173,565,000
トーマンエレクトロニクス	93,000	1,089	101,277,000
フジ・コーポレーション	53,200	525	27,930,000
シークス	153,400	1,091	167,359,400
オーエムツーカーネットワーク	33,300	475	15,817,500
マクニカ	85,000	1,910	162,350,000
川澄化学工業	240,000	540	129,600,000
理研計器	179,900	677	121,792,300
キヤノン	87,000	3,780	328,860,000
遠藤製作所	37,600	436	16,393,600
萩原工業	67,000	1,142	76,514,000

桑山	10,400	365	3,796,000
藤森工業	40,500	1,125	45,562,500
ムトー精工	101,300	595	60,273,500
リンテック	46,000	2,423	111,458,000
伊藤忠	105,000	866	90,930,000
スクロール	272,900	270	73,683,000
三共生興	41,000	259	10,619,000
三井物産	460,000	1,412	649,520,000
三菱商事	163,000	2,162	352,406,000
佐藤商事	79,300	451	35,764,300
ヤマトインタ-ナショナル	51,200	351	17,971,200
ナガホリ	71,000	178	12,638,000
ニッセンHD	341,700	519	177,342,300
三菱UFJフィナンシャルG	1,770,000	399	706,230,000
三井住友フィナンシャルG	196,000	2,595	508,620,000
北越銀行	795,000	171	135,945,000
みずほフィナンシャルG	200,000	134	26,800,000
芙蓉総合リース	10,200	2,536	25,867,200
トモニホールディングス	414,800	285	118,218,000
MS&AD	26,000	1,937	50,362,000
NECキャピタルソリューション	238,800	1,138	271,754,400
京阪神不動産	149,000	418	62,282,000
明和地所	205,100	449	92,089,900
日本エスリード	267,100	699	186,702,900
日神不動産	423,600	440	186,384,000
リベステ	722	105,800	76,387,600
サンヨーハウジ 名古屋	2,229	74,600	166,283,400
ファースト住建	326,300	663	216,336,900
サカイ引越センター	57,800	1,612	93,173,600
アルプス物流	295,500	820	242,310,000
ヒューテックノオリン	262,700	641	168,390,700
川崎近海汽船	579,000	269	155,751,000
住友倉庫	220,000	380	83,600,000
東陽倉庫	500,000	174	87,000,000
日本電信電話	80,000	3,805	304,400,000
KDDI	250	554,000	138,500,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,100	148,400	163,240,000
エムティーアイ	1,213	149,500	181,343,500
日本医療事務センター	514,000	424	217,936,000
KSK	43,500	428	18,618,000
トーカイ	83,400	1,482	123,598,800
ワオ・コーポレーション	153,600	137	21,043,200
ステップ	137,000	495	67,815,000
日鐵商事	518,000	234	121,212,000
日立機材	339,000	412	139,668,000
因幡電機産業	34,800	2,139	74,437,200
バイテック	87,500	634	55,475,000
やまや	183,700	665	122,160,500
合計	38,105,337		25,468,763,000

(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	日本リテールファンド	894	116,577,600	
	積水ハウス・S I 投資法人	208	75,400,000	

	いちご不動産投資法人	698	69,869,800	
投資証券 合計		1,800	261,847,400	
合計		1,800	261,847,400	

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。

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。

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前特定期間（平成22年5月11日から平成22年11月10日まで）及び当特定期間（平成22年11月11日から平成23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

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前期	当期
	平成22年11月10日現在	平成23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	51,554,614	33,888,233
親投資信託受益証券	4,182,649,368	3,757,937,943
未収入金	65,000,000	59,500,000
流動資産合計	4,299,203,982	3,851,326,176
資産合計	4,299,203,982	3,851,326,176
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	60,175,149	54,667,119
未払解約金	3,892,659	3,449,889
未払受託者報酬	379,351	342,732
未払委託者報酬	9,294,388	8,397,404
その他未払費用	176,347	157,465
流動負債合計	73,917,894	67,014,609
負債合計	73,917,894	67,014,609
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,017,514,972	5,466,711,983
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 1,792,228,884	1,682,400,416
(分配準備積立金)	278,839,490	162,710,559
元本等合計	4,225,286,088	3,784,311,567
純資産合計	4,225,286,088	3,784,311,567
負債純資産合計	4,299,203,982	3,851,326,176

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	29,406	22,593
有価証券売買等損益	50,524,616	142,788,575
営業収益合計	50,495,210	142,811,168
営業費用		
受託者報酬	1,176,193	1,050,335
委託者報酬	1 28,817,789	25,734,441
その他費用	176,347	157,465
営業費用合計	30,170,329	26,942,241
営業利益又は営業損失()	80,665,539	115,868,927
経常利益又は経常損失()	80,665,539	115,868,927
当期純利益又は当期純損失()	80,665,539	115,868,927
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,450,561	2,804,621
期首剰余金又は期首欠損金()	1,632,104,835	1,792,228,884
剰余金増加額又は欠損金減少額	133,879,241	179,699,801
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	133,879,241	179,699,801
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,811,571	13,051,455
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	29,811,571	13,051,455
分配金	2 184,976,741	169,884,184
期末剰余金又は期末欠損金()	1,792,228,884	1,682,400,416

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23年5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。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
1. 1 期首元本額	6,379,958,921円	6,017,514,972円
期中追加設定元本額	104,295,368円	43,351,252円
期中一部解約元本額	466,739,317円	594,154,241円
2. 特定期間末日における受益権の総数	6,017,514,972口	5,466,711,983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1,792,228,884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1,682,400,416円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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	1,119,446円	976,915円

2. 2 分配金の計算過程

<p>（自平成22年5月11日 至平成22年7月12日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（25,995,394円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（24,397,922円）及び分配準備積立金（398,419,716円）より分配対象額は448,813,032円（1万口当たり714.07円）であり、うち62,853,013円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成22年11月11日 至平成23年1月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（21,620,479円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,170,649円）及び分配準備積立金（270,478,080円）より分配対象額は318,269,208円（1万口当たり543.96円）であり、うち58,509,760円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成22年7月13日 至平成22年9月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,710,446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（26,026,418円）及び分配準備積立金（354,402,034円）より分配対象額は404,138,898円（1万口当たり652.38円）であり、うち61,948,579円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成23年1月12日 至平成23年3月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（27,916,742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（26,019,992円）及び分配準備積立金（225,746,133円）より分配対象額は279,682,867円（1万口当たり493.20円）であり、うち56,707,305円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成22年9月11日 至平成22年11月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（32,853,870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（26,246,006円）及び分配準備積立金（306,160,769円）より分配対象額は365,260,645円（1万口当たり607.00円）であり、うち60,175,149円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成23年3月11日 至平成23年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（27,929,251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（25,512,371円）及び分配準備積立金（189,448,427円）より分配対象額は242,890,049円（1万口当たり444.31円）であり、うち54,667,119円（1万口当たり100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	前期 自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	当期 自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 平成22年11月10日現在	当期 平成23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。	同左
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 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。	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23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	129,912,750	22,484,123
合計	129,912,750	22,484,123

（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 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左

（1口当たり情報）

	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23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)	0.7022円 (7,022円)	0.6922円 (6,922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	2,332,347,640	2,660,275,718	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	198,336,766	183,005,333	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	181,361,646	185,913,823	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	120,256,556	109,577,773	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	126,552,456	110,543,570	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	88,457,012	118,160,876	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	363,693,043	390,460,850	
親投資信託受益証券 合計		3,411,005,119	3,757,937,943	
合計		3,411,005,119	3,757,937,943	

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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前特定期間（平成22年5月11日から平成22年11月10日まで）及び当特定期間（平成22年11月11日から平成23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

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期 平成22年11月10日現在		当 期 平成23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		165,160,839		117,388,412
親投資信託受益証券		13,649,528,767		12,854,579,919
未収入金		133,000,000		103,000,000
流動資産合計		13,947,689,606		13,074,968,331
資産合計		13,947,689,606		13,074,968,331
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		90,909,669		81,195,245
未払解約金		36,249,436		16,492,161
未払受託者報酬		1,216,770		1,159,835
未払委託者報酬		31,637,244		30,156,413
その他未払費用		570,739		534,701
流動負債合計		160,583,858		129,538,355
負債合計		160,583,858		129,538,355
純資産の部				
元本等				
元本	1	22,727,417,288		20,298,811,420
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2	8,940,311,540		7,353,381,444
(分配準備積立金)		1,496,544,315		1,294,086,547
元本等合計		13,787,105,748		12,945,429,976
純資産合計		13,787,105,748		12,945,429,976
負債純資産合計		13,947,689,606		13,074,968,331

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成22年5月11日 至平成22年11月10日	自平成22年11月11日 至平成23年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	87,065	76,314
有価証券売買等損益	451,424,320	1,058,551,152
営業収益合計	451,337,255	1,058,627,466
営業費用		
受託者報酬	3,805,414	3,565,127
委託者報酬	1 98,944,493	92,696,517
その他費用	570,739	534,701
営業費用合計	103,320,646	96,796,345
営業利益又は営業損失()	554,657,901	961,831,121
経常利益又は経常損失()	554,657,901	961,831,121
当期純利益又は当期純損失()	554,657,901	961,831,121
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	10,757,454	14,736,527
期首剰余金又は期首欠損金()	8,999,167,873	8,940,311,540
剰余金増加額又は欠損金減少額	917,082,526	926,748,680
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	917,082,526	926,748,680
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,728,110	34,162,502
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	31,728,110	34,162,502
分配金	2 282,597,636	252,750,676
期末剰余金又は期末欠損金()	8,940,311,540	7,353,381,444

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23年5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。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
1. 1 期首元本額	24,969,814,901円	22,727,417,288円
期中追加設定元本額	80,269,976円	93,140,306円
期中一部解約元本額	2,322,667,589円	2,521,746,174円
2. 特定期間末日における受益権の総数	22,727,417,288口	20,298,811,420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8,940,311,540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7,353,381,444円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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	9,684,195円	9,111,077円

2. 2 分配金の計算過程

<p>(自平成22年5月11日 至平成22年7月12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(43,278,132円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,002,830,473円)及び分配準備積立金(1,711,191,615円)より分配対象額は2,757,300,220円(1万口当たり1,132.83円)であり、うち97,359,436円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成22年11月11日 至平成23年1月11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(55,910,540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(907,464,866円)及び分配準備積立金(1,438,347,820円)より分配対象額は2,401,723,226円(1万口当たり1,097.47円)であり、うち87,536,783円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成22年7月13日 至平成22年9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(40,400,339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(973,148,892円)及び分配準備積立金(1,603,991,203円)より分配対象額は2,617,540,434円(1万口当たり1,109.97円)であり、うち94,328,531円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成23年1月12日 至平成23年3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(57,555,155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(872,878,905円)及び分配準備積立金(1,348,308,640円)より分配対象額は2,278,742,700円(1万口当たり1,084.87円)であり、うち84,018,648円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成22年9月11日 至平成22年11月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(95,315,920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(939,636,026円)及び分配準備積立金(1,492,138,064円)より分配対象額は2,527,090,010円(1万口当たり1,111.91円)であり、うち90,909,669円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成23年3月11日 至平成23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(99,160,670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(844,865,618円)及び分配準備積立金(1,276,121,122円)より分配対象額は2,220,147,410円(1万口当たり1,093.73円)であり、うち81,195,245円(1万口当たり40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	前期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当期 自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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。	同左
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。	同左
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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 平成22年11月10日現在	当期 平成23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。	同左
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	(1)有価証券 同左 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務

	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。	同左
--	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23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	619,724,526	249,909,683
合計	619,724,526	249,909,683

（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 平成22年11月10日現在	当 期 平成23年5月10日現在
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前 期 自 平成22年5月11日 至 平成22年11月10日	当 期 自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左

（1口当たり情報）

	前 期 平成22年11月10日現在	当 期 平成23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)	0.6066円 (6,066円)	0.6377円 (6,377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	2,142,208,628	2,443,403,161	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	685,843,841	632,828,112	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	630,593,359	646,421,252	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,655,718,542	1,508,690,735	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	1,696,900,497	1,482,242,584	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	1,123,921,581	1,501,334,447	

	ダイワ好配当日本株マザーファンド	4,321,590,563	4,639,659,628
親投資信託受益証券 合計		12,256,777,011	12,854,579,919
合計		12,256,777,011	12,854,579,919

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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

平成23年5月31日

資産総額	3,315,847,179円
負債総額	2,414,986円
純資産総額（ - ）	3,313,432,193円
発行済数量	4,130,002,092口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8023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

平成23年5月31日

資産総額	141,998,341,842円
負債総額	5,466,478,132円
純資産総額（ - ）	136,531,863,710円
発行済数量	117,636,662,646口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1606円

（参考）ダイワ日本国債マザーファンド
純資産額計算書

平成23年5月31日

資産総額	126,073,030,324円
負債総額	543,088,790円
純資産総額（ - ）	125,529,941,534円
発行済数量	113,058,553,513口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1103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

平成23年5月31日

資産総額	584,227,464,576円
負債総額	5,606,376,135円
純資産総額（ - ）	578,621,088,441円
発行済数量	611,108,430,538口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9468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

平成23年5月31日

資産総額	13,917,719,139円
負債総額	36,050,000円
純資産総額（ - ）	13,881,669,139円
発行済数量	13,448,131,712口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0322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

平成23年5月31日

資産総額	2,767,195,911円
負債総額	12,944,000円
純資産総額（ - ）	2,754,251,911円
発行済数量	3,018,942,249口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9123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

平成23年5月31日

資産総額	2,716,184,658円
負債総額	8,682,453円
純資産総額（ - ）	2,707,502,205円
発行済数量	3,064,545,328口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8835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

平成23年5月31日

資産総額	2,604,765,206円
負債総額	50,000円
純資産総額（ - ）	2,604,715,206円
発行済数量	1,967,681,398口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3237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

平成23年5月31日

資産総額	26,401,368,061円
負債総額	181,812,318円
純資産総額（ - ）	26,219,555,743円
発行済数量	25,136,844,021口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0431円

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

平成23年5月31日

資産総額	3,767,912,226円
負債総額	5,763,953円
純資産総額（ - ）	3,762,148,273円
発行済数量	5,378,956,268口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6994円

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

純資産額計算書

平成23年5月31日

資産総額	12,650,097,787円
負債総額	38,577,157円
純資産総額（ - ）	12,611,520,630円
発行済数量	19,885,913,576口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6342円

（参考）ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

 原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況

および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成23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、3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、役付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. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者である運用本部長（CIO）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

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。

二．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．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、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。

平成23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	6	22,827
追加型株式投資信託	369	7,141,218
株式投資信託 合計	375	7,164,046
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,800,260
公社債投資信託 合計	17	2,800,260
総合計	392	9,964,306

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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。

なお、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、また、当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

3．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,783,803	1,820,358
有価証券	26,970,072	18,987,155
前払金	136	579
前払費用	77,248	24,840
未収入金	3,858	6,925
未収委託者報酬	7,030,430	6,933,076
未収収益	90,787	41,963
貯蔵品	30,324	23,337
繰延税金資産	566,334	286,080
その他	256,955	501,484
流動資産計	39,809,953	28,625,803
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	1,186,818	967,190
器具備品（純額）	318,162	332,407
	757,333	634,782

建設仮勘定		111,322		-
無形固定資産		1,751,209		2,414,530
ソフトウェア		1,558,342		1,364,617
ソフトウェア仮勘定		179,630		1,037,069
電話加入権		11,850		11,850
商標権		660		396
その他		725		596
投資その他の資産		10,657,920		18,825,476
投資有価証券		10,018,677		12,339,547
関係会社株式		737,012		5,141,069
出資金		178,806		142,215
従業員に対する長期貸付金		104,419		99,889
差入保証金		617,615		609,781
長期前払費用		8,402		7,607
投資不動産（純額）	1	489,861	1	490,114
貸倒引当金	3	1,496,873		4,750
固定資産計		13,595,948		22,207,196
資産合計		53,405,901		50,833,000

(単位:千円)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	46,289	46,454
未払金	7,304,929	6,501,119
未払収益分配金	31,110	27,599
未払償還金	261,645	119,838
未払手数料	3,847,895	3,725,807
その他未払金	2	2,627,872
未払費用	2,212,051	2,395,029
未払法人税等	692,446	895,379
未払消費税等	104,897	383,973
賞与引当金	838,400	263,000
その他	168,621	-
流動負債計	11,367,635	10,484,955
固定負債		
退職給付引当金	1,179,482	1,410,635
役員退職慰労引当金	39,300	59,160
繰延税金負債	1,963,856	1,977,913
固定負債計	3,182,638	3,447,708
負債合計	14,550,274	13,932,663
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727

資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	-
繰越利益剰余金	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計	12,259,401	10,248,473
株主資本合計	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益	55,712	85,902
評価・換算差額等合計	73,774	18,137
純資産合計	38,855,627	36,900,336
負債・純資産合計	53,405,901	50,833,000

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,362,142	72,303,483
その他営業収益	432,889	345,390
営業収益計	63,795,032	72,648,873
営業費用		
支払手数料	37,293,022	41,437,322
広告宣伝費	917,652	967,991
公告費	257	1,256
受益証券発行費	131	3
調査費	4,336,342	6,192,360
調査費	771,298	831,159
委託調査費	3,565,043	5,361,200
委託計算費	601,778	718,414
営業雑経費	1,793,369	1,806,147
通信費	284,273	287,454
印刷費	837,408	674,758
協会費	45,168	47,465
諸会費	11,118	10,778
その他営業雑経費	615,400	785,691
営業費用計	44,942,552	51,123,496
一般管理費		
給料	4,847,709	4,192,794
役員報酬	217,200	157,200
給料・手当	3,478,553	3,545,655
賞与	313,555	226,939
賞与引当金繰入額	838,400	263,000
福利厚生費	680,311	619,459
交際費	80,019	68,476
寄付金	-	638
旅費交通費	178,718	266,082
租税公課	166,974	169,305
不動産賃借料	731,728	680,147
退職給付費用	303,972	334,864
役員退職慰労引当金繰入額	37,500	28,500
固定資産減価償却費	941,172	897,352
諸経費	990,534	1,170,318
一般管理費計	8,958,640	8,427,939
営業利益	9,893,838	13,097,437

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		61,884	1	573,514
有価証券利息		87,447		23,029
受取利息		3,425		2,673
時効成立分配金・償還金		40,507		149,120
投資有価証券売却益		213,196		38,591
有価証券償還益		33,090		-
その他		82,595		45,094
営業外収益計		522,147		832,022
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		101,945		98,613
貯蔵品廃棄損		44,214		25,533
投資有価証券売却損		263,840		7,515
為替差損		7,870		-
投資不動産管理費用		-		20,028
その他		68,406		36,603
営業外費用計		486,276		188,294
経常利益		9,929,709		13,741,165
特別利益				
貸倒引当金戻入額		159,959		614,232
特別利益計		159,959		614,232
特別損失				
固定資産除却損	2	16,233	2	1,067
ゴルフ会員権評価損		-		21,290
減損損失	3	76,450	3	35,468
その他		-		768
特別損失計		92,683		58,595
税引前当期純利益		9,996,985		14,296,802
法人税、住民税及び事業税		4,592,433		4,834,931
法人税等調整額		516,225		256,140
法人税等合計		4,076,208		5,091,072
当期純利益		5,920,777		9,205,730

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
当期変動額合計	-	2,800,000
当期末残高	2,800,000	-
繰越利益剰余金		
前期末残高	9,659,553	9,085,103
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	2,800,000
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	789,072
当期末残高	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計		
前期末残高	12,833,851	12,259,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657

当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	12,259,401	10,248,473

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	39,503,851	38,929,401
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	574,450	2,010,927
当期末残高	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	618,549	18,061
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	600,487	85,978
当期変動額合計	600,487	85,978
当期末残高	18,061	104,040
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	-	55,712
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,712	141,615
当期変動額合計	55,712	141,615
当期末残高	55,712	85,902
評価・換算差額等合計		
前期末残高	618,549	73,774
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	544,775	55,636
当期末残高	73,774	18,137
純資産合計		
前期末残高	38,885,301	38,855,627
当期変動額		
剰余金の配当	6,495,227	11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	29,674	1,955,290
当期末残高	38,855,627	36,900,336

重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法によ り計上しております。 (2) その他有価証券 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。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価 基準及び評価方法	時価法により計上しておりま す。	同左
3. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 定率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 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産 （リース資産を除く） 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）に基づいておりま す。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 同左 (2) 無形固定資産 同左
4. 引当金の計上基準	(3) 長期前払費用 定額法によっております。 (1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるた め、一般債権については貸倒実績 率法により、貸倒懸念債権及び破 産更生債権等については財務内容 評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員およ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。	(3) 長期前払費用 同左 (1) 貸倒引当金 債権の貸倒損失に備えるため、 一般債権については貸倒実績率法 により、貸倒懸念債権及び破産更 生債権等については財務内容評価 法により計上しております。 (2) 賞与引当金 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。

5 . ヘッジ会計の方法	<p>(3) 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各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。</p> <p>(4) 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。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金 同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 同左</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 同左</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 同左</p> <p>(3) ヘッジ方針 同左</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 同左</p>
6 . リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>	
7 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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処理によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 同左</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 同左</p>

会計方針の変更

<p>前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)</p>
---	---

	<p>(資産除去債務に関する会計基準の適用)</p> <p>当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。</p> <p>なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>
--	--

表示方法の変更

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
	<p>(損益計算書)</p> <p>1. 「有価証券償還益」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外収益に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。</p> <p>なお、当事業年度の、営業外収益の「その他」に含まれている「有価証券償還益」の金額は、3,185千円であります。</p> <p>2. 「投資不動産管理費用」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりましたが、重要性が増したため、当事業年度より、営業外費用の「投資不動産管理費用」として区分掲記しております。</p> <p>なお、前事業年度の営業外費用の「その他」に含まれている「投資不動産管理費用」の金額は、17,078千円であります。</p> <p>3. 「為替差損」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。なお、当事業年度の、営業外費用の「その他」に含まれている「為替差損」の金額は、8,906千円であります。</p>

追加情報

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
<p>(投資有価証券売却損益の計上区分の変更)</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利益に与える影響はありません。</p>	

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 815,365千円 器具備品 1,938,369千円 投資建物 688,305千円 投資器具備品 27,339千円</p> <p>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。 未払金 3,002,391千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 854,118千円 器具備品 2,129,756千円 投資建物 700,991千円 投資器具備品 28,141千円</p> <p>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。 未払金 2,591,913千円</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

前事業年度 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	当事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
<p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,439千円 ソフトウェア 14,793千円</p>	<p>1 関係会社項目 関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 受取配当金 460,584千円</p> <p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,067千円</p>

3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。
場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,450千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。
場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22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）

	前事業年度末 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
平成21年6月19日 定時株主総会	普通株式	6,495	2,490	平成21年 3月31日	平成21年 6月22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

平成22年6月25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通り提案しております。

剰余金の配当の総額 11,216百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 4,300円
基準日 平成22年3月31日
効力発生日 平成22年6月28日

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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）

	前事業年度末 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
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 6月28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

平成23年6月24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通り提案しております。

剰余金の配当の総額 9,182百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 3,520円
 基準日 平成23年3月31日
 効力発生日 平成23年6月27日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 該当事項はありません。 (2) 未経過リース料期末残高相当額 該当事項はありません。 (3) 支払リース料及び減価償却費相当額	

支払リース料	985千円
減価償却費相当額	985千円
(4)減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	

(金融商品関係)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

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。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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、投資信託、株式、債券であります。投資信託は余資運用及び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、非上場株式並びに子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、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。債券は外貨建資産担保債券を保有しており、発行体の信用リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る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。

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5. ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(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、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

() 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、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、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、保

有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

() デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

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財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2. 金融商品の時価等に関する事項」における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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,783,803	4,783,803	-
(2) 未収委託者報酬	7,030,430	7,030,430	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	34,012,542	34,012,542	-
資産計	45,826,776	45,826,776	-
(1) 未払手数料	3,847,895	3,847,895	-
(2) その他未払金	3,164,277	3,164,277	-
(3) 未払費用（*1）	1,696,832	1,696,832	-
負債計	8,709,004	8,709,004	-
デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(7,985)	(7,985)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(159,516)	(159,516)	-
デリバティブ取引計	(167,501)	(167,501)	-

（*1）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。

（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、及び(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、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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<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：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	
外貨建資産担保債券(*1)	311,905
非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	737,012
(3) 長期差入保証金	617,615

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。

(*1) 外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<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

(単位：千円)

	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	4,783,803	-	-	-
未収委託者報酬	7,030,430	-	-	-
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	-	746,330	1,547,596	-
合計	11,814,233	746,330	1,547,596	-

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には含めておりません。

（追加情報）

当事業年度より、平成20年3月31日公表の「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第10号）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号）を適用しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び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、非上場株式並びに子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、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る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。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社では、これをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（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、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、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、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

（ ）デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

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財務会議において報告を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2. 金融商品の時価等に関する事項」における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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,820,358	1,820,358	-
(2) 未収委託者報酬	6,933,076	6,933,076	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	30,154,565	30,154,565	-
資産計	38,908,001	38,908,001	-
(1) 未払手数料	3,725,807	3,725,807	-
(2) その他未払金	2,627,872	2,627,872	-
(3) 未払費用（*1）	1,951,710	1,951,710	-
負債計	8,305,391	8,305,391	-
デリバティブ取引（*2）	183,430	183,430	-

（*1）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。

（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

（1）現金・預金、及び（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、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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<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：千円）

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069
(3) 長期差入保証金	609,781

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

（単位：千円）

	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	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
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	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（貸借対照表計上額 737,012千円）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、記載しておりません。

2．その他有価証券

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1)株式	76,077	55,101	20,975
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	4,728,727	4,379,317	349,410
小計	4,804,805	4,434,419	370,385
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	29,207,737	29,608,576	400,839
小計	29,207,737	29,608,576	400,839
合計	34,012,542	34,042,996	30,453

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)、外貨建資産担保債券(貸借対照表計上額(貸倒引当金控除前) 1,804,069千円)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. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	13,871,201	213,196	263,840
合計	13,871,201	213,196	263,840

当事業年度(平成23年3月31日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)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、記載しておりません。

2. その他有価証券

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
(1)株式	54,283	55,101	818
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	25,277,982	25,890,888	612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724

合計	30,154,565	30,329,983	175,417
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)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. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

通貨関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	280,388	-	7,985	7,985
	合計	280,388	-	7,985	7,985

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連

(単位：千円)

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,303,784	-	159,516	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,303,784	-	159,516	

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連

(単位：千円)

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
	合計		2,435,030	-	183,430	

(退職給付関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,179,482千円 退職給付引当金 1,179,482千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 175,249千円 その他 128,723千円</p> <p>退職給付費用 303,972千円</p> <p>なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,410,635千円 退職給付引当金 1,410,635千円</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 191,300千円 その他 143,564千円</p> <p>退職給付費用 334,864千円</p> <p>なお、「その他」の143,564千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。</p>

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>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</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 915,392</p> <p>貸倒引当金 609,077</p> <p>退職給付引当金 479,931</p> <p>賞与引当金 302,163</p> <p>株式譲渡損繰延 287,965</p> <p>投資有価証券評価損 225,062</p> <p>外貨建有価証券換算差額 176,654</p> <p>未払事業税 163,956</p> <p>出資金評価損 126,163</p> <p>その他有価証券評価差額金 65,652</p> <p>未払社会保険料 44,836</p>	<p>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</p> <p>繰延税金資産 千円</p> <p>減損損失 928,499</p> <p>退職給付引当金 573,987</p> <p>連結法人間取引（譲渡損） 294,850</p> <p>投資有価証券評価損 216,468</p> <p>未払事業税 212,062</p> <p>出資金評価損 128,238</p> <p>その他有価証券評価差額金 125,395</p> <p>賞与引当金 107,014</p> <p>器具備品 38,093</p> <p>役員退職慰労引当金 24,072</p> <p>未払社会保険料 11,722</p>

繰延ヘッジ損益	38,221	その他	28,763
器具備品	38,093	繰延税金資産小計	2,689,169
役員退職慰労引当金	15,991	評価性引当額	1,547,609
その他	27,316	繰延税金資産合計	1,141,560
繰延税金資産小計	3,516,480	繰延税金負債	
評価性引当額	2,139,543	連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301
繰延税金資産合計	1,376,937	繰延ヘッジ損益	58,934
繰延税金負債		その他	2,156
株式譲渡益繰延	2,772,301	繰延税金負債合計	2,833,392
その他	2,156	繰延税金負債の純額	1,691,832
繰延税金負債合計	2,774,458		
繰延税金負債の純額	1,397,521		
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		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	
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。		法定実効税率（調整）	40.69%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25
		住民税均等割	0.02
		評価性引当額	4.14
		その他	0.07
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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（千円）	科目	期末残高（千円）
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	598,500	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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等に関するMASへ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られております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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	証券投資信託の代行手数料	22,043,473	未払手数料	2,870,857
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	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	676,687	未払手数料	64,597
							為替予約	3,946,508	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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、代行手数料を支払っております。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

3. 大和証券エスエムピーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India)Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(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等に関するMASへ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られております。

(2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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	証券投資信託の代行手数料	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券 キャピタル ・ マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	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	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	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	1,085,626	未払費用	129,623

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

(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。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

[関連情報]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が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]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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負ののれん発生益に関する情報]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

(追加情報)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

(1株当たり情報)

前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 14,895.63円 1株当たり当期純利益 2,269.77円	1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円
なお、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。	同左

(注) 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 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
当期純利益(千円)	5,920,777	9,205,730
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)

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
該当事項はありません。	同左

(追加情報)

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インド共和国においてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited(以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited(以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited(以下、「DAMI」)及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited(以下、「DTC」)として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年 1月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

(単位：千円)

	DAMI	DTC
取得原価	1,059,552	2,717
増資の引受	3,204,985	9,944
貸借対照表計上額(注) 関係会社株式	4,391,020	13,037
出資比率	91.0%	99.9%

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

4 【利害関係人との取引制限】

原簿原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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。）、

通常の実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

平成22年12月20日付で、Shinsei Asset Management (India) Private Limited（現Daiwa Asset Management (India) Private Limited）およびShinsei Trustee Company (India) Private Limited（現Daiwa Trustee Company (India) Private Limited）への出資を行ない、当該2社を子会社といたしました。

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

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または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】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成23年3月末日現在）

事業の内容

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。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成23年3月 末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	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。
寿証券株式会社	305	
奈良証券株式会社	117	
ニュース証券株式会社	877	
日の出証券株式会社	4,650	
松阪証券株式会社	100	
むさし証券株式会社	5,000	
楽天証券株式会社	7,495	
岐阜信用金庫	21,826	（注1）
株式会社きらやか銀行	17,700	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社佐賀共栄銀行	2,100	
株式会社静岡中央銀行	2,000	
株式会社商工組合中央金庫	218,653	（注2）
湘南信用金庫	25,995	（注1）
全国信用協同組合連合会	53,855	（注3）
株式会社但馬銀行	5,481	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社東北銀行	8,233	
株式会社東和銀行	38,653	
株式会社栃木銀行	27,408	
株式会社富山第一銀行	8,000	
株式会社福岡中央銀行	2,500	
株式会社福島銀行	18,127	

ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド(香港上海銀行)	1,282,396	
---	-----------	--

(注1) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 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。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」および「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン・アンド・スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 454千米ドル(約36百万円)(平成22年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

<参考> 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド

資本金の額 1,033千ユーロ(約111百万円)(平成22年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

<略>

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円(平成23年3月末日現在)

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

独立監査人の監査報告書

平成23年6月24日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月11日から平成23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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成23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すべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月24日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月11日から平成23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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成23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すべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月24日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月11日から平成23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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成23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すべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月2日

大和証券投資信託委託株式会社

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	森 公 高
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津 広

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証券投資信託委託株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、大和証券投資信託委託株式会社の平成23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すべ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。

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)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。

独立監査人の監査報告書

平成22年12月10日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年5月11日から平成22年11月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年12月10日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年5月11日から平成22年11月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年12月10日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年5月11日から平成22年11月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成22年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

大和証券投資信託委託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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

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証券投資信託委託株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、大和証券投資信託委託株式会社の平成22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すべ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。

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)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。