

【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24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 白川 真
【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 本店の所在の場所に同じ
【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24年2月4日から平成25年2月5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24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）」有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）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】

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

受託会社	住友信託銀行 株式会社 (6) 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	< 略 >
------	---	-------

< 略 >

6：関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

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

< 委託会社の概況（平成23年11月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

受託会社	三井住友信託銀行 株式会社 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	< 略 >
------	--	-------

< 略 >

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

< 委託会社の概況（平成24年5月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

< 訂正前 >

< 略 >

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

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

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

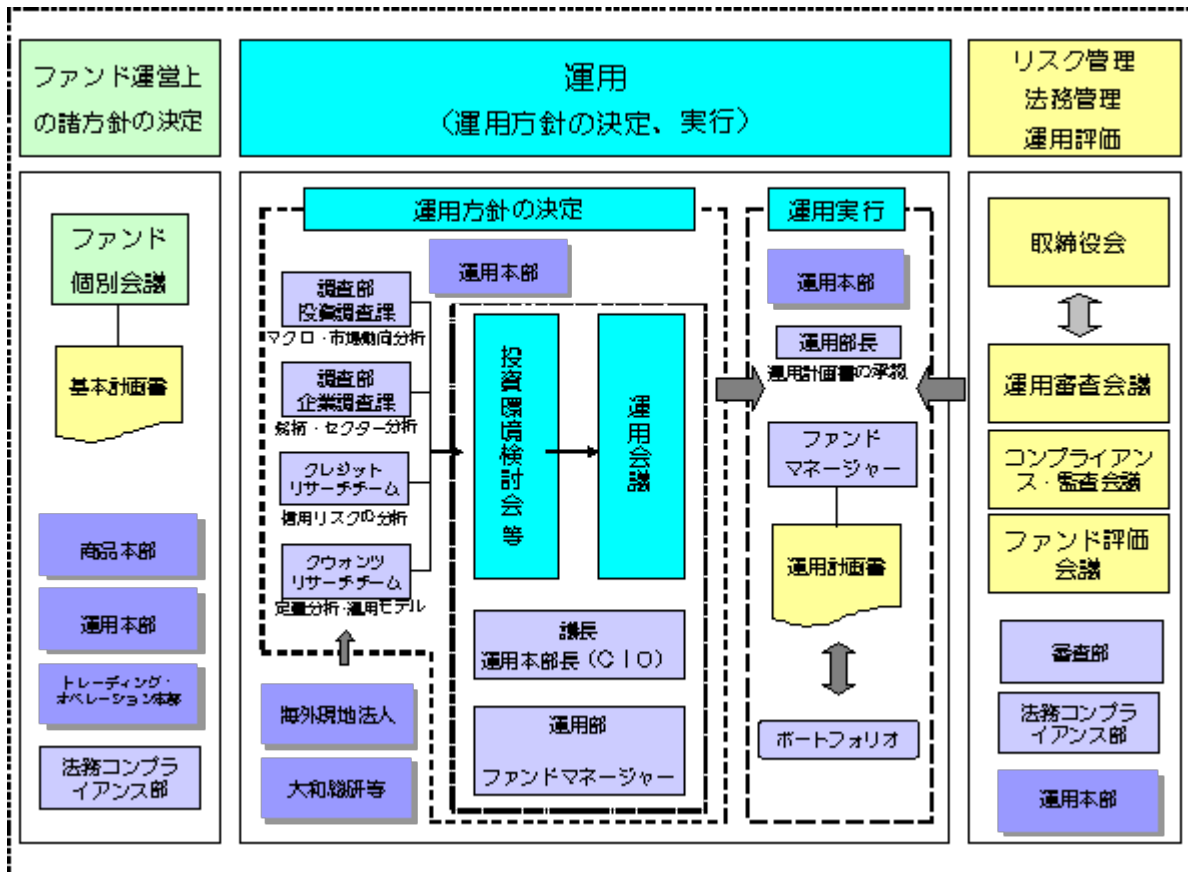
< 略 >

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

< 略 >

ロ．投資環境の検討

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。

< 略 >

職務権限

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

イ．運用本部長（CIO）（1名）

< 略 >

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

< 略 >

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

< 略 >

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

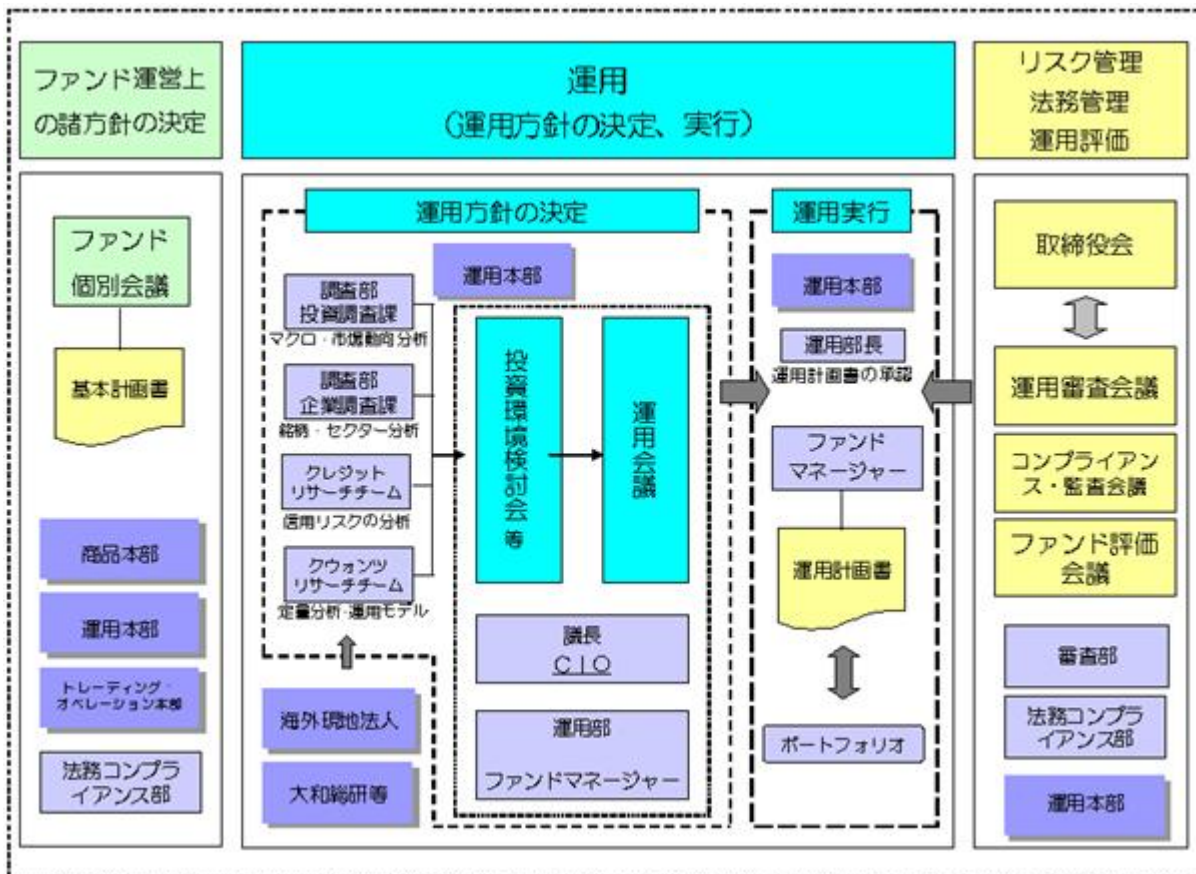
< 略 >

上記の運用体制は平成23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 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

< 略 >

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるC I O（Chief Investment Officer）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。

< 略 >

職務権限

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

イ．C I O（Chief Investment Officer）（1名）

< 略 >

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

< 略 >

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

< 略 >

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

< 略 >

上記の運用体制は平成24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】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

() 上記は、平成23年12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 >

() 上記は、平成24年5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 >

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24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,457,751,998	99.31
内 日本	2,457,751,998	99.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,137,325	0.69
純資産総額	2,474,889,323	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（平成24年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	775,880,752	1.1445 887,995,547	1.1479 890,633,515	35.99
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	756,355,329	1.1738 887,809,887	1.1484 868,598,459	35.10
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	228,297,870	1.0907 249,004,486	1.0036 229,119,742	9.26
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	126,777,049	0.9811 124,380,962	0.9643 122,251,108	4.94
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	131,673,689	0.9385 123,575,757	0.8856 116,610,218	4.71
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	74,086,415	1.1529 85,414,227	1.0675 79,087,248	3.20
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	88,342,535	0.9245 81,672,673	0.8936 78,942,889	3.19
8	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	104,720,999	0.7493 78,467,444	0.6924 72,508,819	2.93

(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
-----------	------

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
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
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
平成23年5月末日	3,313,432,193	-	0.8023	-
6月末日	3,236,166,374	-	0.7987	-
7月末日	3,123,474,159	-	0.7806	-

8月末日	3,012,778,812	-	0.7704	-
9月末日	2,872,403,214	-	0.7420	-
10月末日	2,888,490,709	-	0.7591	-
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	2,810,108,392	2,836,542,685	0.7441	0.7511
11月末日	2,722,836,627	-	0.7320	-
12月末日	2,712,916,268	-	0.7406	-
平成24年1月末日	2,660,997,144	-	0.7426	-
2月末日	2,726,257,737	-	0.7821	-
3月末日	2,686,810,560	-	0.7836	-
4月末日	2,635,765,841	-	0.7790	-
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	2,560,967,176	2,584,608,951	0.7583	0.7653
5月末日	2,474,889,323	-	0.7397	-

【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
第12特定期間	0.0210
第13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
第12特定期間	4.3

第13特定期間

4.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第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
第12特定期間	34,639,493	439,104,672
第13特定期間	25,669,129	424,600,240

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	73,331,880,544	91.50
内 ユーロ	17,312,125,064	21.60
内 ノルウェー	2,085,504,924	2.60
内 スウェーデン	2,643,257,920	3.30
内 デンマーク	31,035,629	0.04
内 イギリス	10,339,786,360	12.90
内 ポーランド	3,047,395,215	3.80
内 チェコ	289,882,240	0.36
内 カナダ	12,199,693,920	15.22
内 アメリカ	21,370,237,688	26.67
内 オーストラリア	4,012,961,584	5.01
特殊債券	4,880,733,834	6.09
内 オーストラリア	4,880,733,834	6.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,928,128,539	2.41
純資産総額	80,140,742,917	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）	588,960,000	0.73

内 日本	588,960,000	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	102,700,000	154.19 12,497,634,287	158.01 17,248,482	8.125000 2021/08/15	15.98
2	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	40,000,000	152.16 7,432,506,084	155.29 6,198,760	8.000000 2021/06/07	9.46
3	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	53,700,000	153.22 6,493,724,093	156.99 8,327,239	8.125000 2021/05/15	8.30
4	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	41,000,000	157.52 6,304,731,080	165.19 6,957,815	6.250000 2030/01/04	8.25
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	37,600,000	175.60 5,059,025,513	180.25 6,045,543	9.000000 2025/06/01	6.48
6	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	30,000,000	119.28 3,493,497,354	121.72 3,955,494	4.250000 2018/07/04	4.45
7	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	131,500,000	104.35 3,050,435,389	104.24 3,395,215	6.250000 2015/10/24	3.80
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	20,800,000	170.85 2,722,925,280	175.95 3,623,607	8.000000 2027/06/01	3.50
9	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	15,000,000	146.43 2,682,208,254	150.40 2,801,600	6.000000 2028/12/07	3.44
10	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	30,000,000	108.94 2,501,526,266	116.11 3,278,554	6.000000 2021/06/14	3.33
11	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	25,000,000	104.60 2,552,982,643	107.63 2,880,985	4.000000 2022/03/28	3.28
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000,000	154.47 2,261,977,235	163.64 3,224,449	4.750000 2040/07/04	2.99
13	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	25,000,000	109.91 2,103,261,795	115.72 2,455,280	6.250000 2019/06/14	2.76
14	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000,000	133.77 1,958,896,211	144.24 2,106,320	6.250000 2027/07/15	2.64
15	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	160,000,000	111.30 1,937,562,624	111.30 2,510,400	6.750000 2014/05/05	2.42
16	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	16,000,000	149.35 1,885,985,909	151.23 2,661,964	9.000000 2018/11/15	2.38
17	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	14,500,000	156.92 1,743,443,278	160.74 2,816,435	8.000000 2023/06/01	2.23
18	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	18,000,000	113.36 1,561,866,059	115.60 2,740,760	4.750000 2027/04/21	1.99
19	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	12,000,000	166.30 1,529,059,358	167.34 2,664,451	9.750000 2021/06/01	1.92

20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	15,000,000	119.50 1,372,059,869	121.47 1,620,032	5.500000 2023/04/21	1.74
21	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	70,000,000	110.84 1,006,334,504	115.36 1,380,677	3.750000 2021/05/25	1.31
22	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	76,500,000	105.27 1,044,514,037	104.62 1,124,247	6.500000 2013/05/15	1.30
23	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	11,000,000	113.61 956,553,292	121.81 1,600,791	5.750000 2021/05/15	1.28
24	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	11,000,000	104.67 882,238,697	104.16 1,931,881	5.250000 2013/06/01	1.10
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	50,000,000	125.58 683,204,160	129.73 1,747,520	5.000000 2020/12/01	0.88
26	Czech Republic Government Bond	チェコ	国債証券	64,000,000	117.63 286,095,628	119.19 1,882,240	6.950000 2016/01/26	0.36
27	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	2,200,000	107.53 31,085,350	107.36 1,035,628	5.000000 2013/11/15	0.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	91.50%
特殊債券	6.09%
合計	97.59%

(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 2012年6月	売建	500,000	62,420,300	61,050,000	0.08%
		ノルウェー・クローネ売/ 円買 2012年6月	売建	23,000,000	301,785,300	298,080,000	0.37%
		カナダ・ドル売/円買 2012年6月	売建	3,000,000	233,283,300	229,830,000	0.29%

(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

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	256,461,130,268	99.27
内 日本	256,461,130,268	99.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,888,910,281	0.73
純資産総額	258,350,040,549	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	9 1 2 0 年国債	日本	国債証券	13,130,000,000	111.21 14,602,934,865	113.21 129,500	2.300000 2026/09/20	5.75
2	4 3 2 0 年国債	日本	国債証券	11,462,000,000	116.64 13,370,268,450	117.34 127,760	2.900000 2019/09/20	5.21
3	5 8 2 0 年国債	日本	国債証券	11,455,000,000	108.63 12,443,903,600	110.09 611,350	1.900000 2022/09/20	4.88
4	2 3 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	10,399,000,000	108.11 11,242,609,029	106.98 682,120	5.500000 2013/09/20	4.31
5	4 2 2 0 年国債	日本	国債証券	9,478,000,000	114.03 10,808,120,820	114.47 561,380	2.600000 2019/03/20	4.20
6	3 3 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	8,774,000,000	115.84 10,163,816,130	115.53 602,200	3.800000 2016/09/20	3.92
7	1 9 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	9,317,000,000	102.96 9,593,259,470	101.71 693,380	5.900000 2012/09/20	3.67
8	2 8 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	7,708,000,000	114.57 8,831,668,760	113.64 448,280	5.000000 2015/03/20	3.39
9	3 8 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	7,616,000,000	113.57 8,649,718,600	113.72 448,320	2.700000 2018/03/20	3.35
10	3 2 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	7,593,000,000	113.92 8,650,098,460	113.52 725,460	3.700000 2016/03/21	3.34
11	2 9 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	7,340,000,000	114.07 8,373,258,320	113.46 1,037,399	4.200000 2015/09/21	3.22
12	2 7 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	7,416,000,000	112.24 8,324,318,200	111.23 410,080	5.000000 2014/09/22	3.19
13	4 8 2 0 年国債	日本	国債証券	7,031,000,000	114.26 8,034,188,100	115.26 1,000,909	2.500000 2020/12/21	3.14
14	6 4 2 0 年国債	日本	国債証券	7,125,000,000	108.34 7,719,510,800	109.80 463,750	1.900000 2023/09/20	3.03
15	7 0 2 0 年国債	日本	国債証券	6,628,000,000	113.52 7,524,239,600	115.17 600,160	2.400000 2024/06/20	2.95
16	5 2 2 0 年国債	日本	国債証券	6,318,000,000	110.81 7,001,228,670	111.97 770,040	2.100000 2021/09/21	2.74

17	3 7 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	6,033,000,000	114.97 6,936,336,936	114.92 485,580	3.100000 2017/09/20	2.68
18	3 4 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	5,829,000,000	116.00 6,761,985,600	115.74 776,050	3.500000 2017/03/20	2.61
19	7 4 2 0 年国債	日本	国債証券	5,715,000,000	109.84 6,277,466,300	111.51 82,250	2.100000 2024/12/20	2.47
20	4 0 2 0 年国債	日本	国債証券	5,612,000,000	111.64 6,265,406,180	112.04 821,520	2.300000 2018/09/20	2.43
21	5 5 2 0 年国債	日本	国債証券	5,374,000,000	109.90 5,906,246,960	111.05 827,000	2.000000 2022/03/21	2.31
22	2 4 利付国債 2 0 年	日本	国債証券	5,429,000,000	109.23 5,930,259,000	108.22 643,830	4.700000 2014/03/20	2.27
23	6 8 2 0 年国債	日本	国債証券	4,645,000,000	111.43 5,176,203,200	112.95 759,750	2.200000 2024/03/20	2.03
24	8 2 2 0 年国債	日本	国債証券	4,335,000,000	109.44 4,744,614,820	111.27 814,600	2.100000 2025/09/20	1.87
25	8 6 2 0 年国債	日本	国債証券	4,200,000,000	111.64 4,688,924,060	113.48 412,000	2.300000 2026/03/20	1.84
26	5 6 2 0 年国債	日本	国債証券	4,070,000,000	109.87 4,471,789,300	111.05 816,400	2.000000 2022/06/20	1.75
27	4 7 2 0 年国債	日本	国債証券	4,000,000,000	111.83 4,473,440,600	112.73 480,000	2.200000 2020/09/21	1.75
28	4 9 2 0 年国債	日本	国債証券	3,988,000,000	110.93 4,424,087,860	111.97 443,360	2.100000 2021/03/22	1.73
29	8 0 2 0 年国債	日本	国債証券	3,833,000,000	109.54 4,198,936,360	111.34 777,190	2.100000 2025/06/20	1.65
30	6 3 2 0 年国債	日本	国債証券	3,748,000,000	107.44 4,027,054,080	108.87 672,480	1.800000 2023/06/20	1.58

(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	99.27%
合計	99.27%

(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

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	268,306,726,083	97.88
内 香港	8,617,737,526	3.14
内 シンガポール	12,199,470,233	4.45
内 イギリス	27,183,972,797	9.92
内 オランダ	4,575,781,542	1.67
内 フランス	19,892,519,908	7.26
内 ドイツ	850,106,848	0.31
内 カナダ	10,672,250,522	3.89
内 アメリカ	134,313,669,482	49.00
内 オーストラリア	50,001,217,225	18.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,799,884,560	2.12
純資産総額	274,106,610,643	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）	1,578,200,000	0.58
内 日本	1,578,200,000	0.58

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	WESTFIELD GROUP	オーストラ リア	投資証券	22,302,875 14,970,934,200	671.25 934,200	697.27 15,551,335,298	5.67
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	1,340,473 14,929,103,027	11,137.19 103,027	11,536.52 15,464,401,081	5.64
3	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	1,113,884 16,663,999,819	14,960.26 999,819	13,100.60 14,592,553,186	5.32
4	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	1,185,113 7,765,804,799	6,552.72 804,799	6,447.76 7,641,328,937	2.79
5	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラ リア	投資証券	36,085,912 6,960,279,575	192.88 279,575	209.71 7,567,923,030	2.76
6	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	7,880,688 7,039,303,587	893.23 303,587	859.65 6,774,668,114	2.47
7	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	12,656,046 6,504,704,788	513.83 704,788	508.58 6,436,715,021	2.35

8	LINK REIT	香港	投資証券	21,051,720 6,170	293.11 595,960	303.78 6,395,175,708	2.33
9	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	25,875,087 6,238	241.10 509,351	244.92 6,337,533,309	2.31
10	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	10,526,258 6,433	611.16 233,629	596.99 6,284,131,710	2.29
11	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	1,230,839 5,871	4,769.92 1,009,471	4,780.18 5,883,637,387	2.15
12	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	79,683,244 5,275	66.20 596,504	71.56 5,702,523,389	2.08
13	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	688,214 5,629	8,180.45 958,048	8,102.71 5,576,402,865	2.03
14	CAPITAMALL TRUST	シンガポール	投資証券	50,030,392 5,586	111.67 981,428	108.00 5,403,299,847	1.97
15	HCP INC	アメリカ	投資証券	1,683,709 5,392	3,202.57 201,993	3,201.78 5,390,873,210	1.97
16	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	2,128,468 5,850	2,748.78 697,932	2,508.86 5,340,042,700	1.95
17	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	714,175 4,430	6,203.03 1,073,263	5,832.18 4,165,202,865	1.52
18	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	396,597 4,145	10,453.74 923,192	10,455.32 4,146,549,181	1.51
19	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	1,948,153 3,986	2,046.39 691,727	2,115.05 4,120,452,692	1.50
20	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	3,086,595 4,087	1,324.27 508,619	1,326.64 4,094,816,441	1.49
21	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	894,011 4,040	4,519.74 704,787	4,565.52 4,081,626,889	1.49
22	RIOCAN REIT	カナダ	投資証券	1,978,909 4,113	2,078.70 559,326	2,045.75 4,048,361,002	1.48
23	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	オーストラリア	投資証券	49,980,900 3,749	75.00 1,027,324	76.54 3,825,538,086	1.40
24	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	13,033,282 4,026	308.93 479,985	263.87 3,439,218,674	1.25
25	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	2,862,451 3,587	1,253.24 365,571	1,196.42 3,424,714,235	1.25
26	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	35,457,081 3,424	96.51 308,355	93.76 3,324,509,100	1.21
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	419,417 3,216	7,670.15 994,063	7,702.59 3,230,598,029	1.18
28	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	12,193,064 3,227	264.67 991,770	261.76 3,191,739,345	1.16
29	CORIO NV	オランダ	投資証券	911,009 3,486	3,826.70 166,490	3,315.17 3,020,154,444	1.10
30	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	11,850,080 2,866	241.86 136,189	245.69 2,911,486,445	1.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.88%
合計	97.88%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2012年6月	売建	20,000,000	1,584,267,000	578,200,000	0.58%

(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 - R E I Tアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	10,474,161,200	96.75
内 日本	10,474,161,200	96.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	352,375,902	3.25
純資産総額	10,826,537,102	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	2,000	744,000.00 1,488,000,000	715,000.00 1,430,000,000	13.21
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	1,850	710,000.00 1,313,500,000	692,000.00 1,280,200,000	11.82
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	5,300	126,700.00 671,510,000	123,300.00 653,490,000	6.04

4	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	153,800.00 3,800 584,440,000	144,600.00 549,480,000	5.08
5	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	659,000.00 700 461,300,000	671,000.00 469,700,000	4.34
6	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	19,554.66 23,000 449,757,347	20,350.00 468,050,000	4.32
7	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	93,100.00 5,219 485,888,900	84,700.00 442,049,300	4.08
8	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	229,300.00 1,950 447,135,000	223,800.00 436,410,000	4.03
9	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	539,000.00 716 385,924,000	534,000.00 382,344,000	3.53
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	705,000.00 550 387,750,000	695,000.00 382,250,000	3.53
11	森ヒルズリート	日本	投資証券	316,000.00 1,200 379,200,000	318,500.00 382,200,000	3.53
12	森トラスト総合リート	日本	投資証券	674,000.00 550 370,700,000	669,000.00 367,950,000	3.40
13	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	449,000.00 800 359,200,000	437,000.00 349,600,000	3.23
14	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	515,000.00 650 334,750,000	511,000.00 332,150,000	3.07
15	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	413,000.00 700 289,100,000	418,000.00 292,600,000	2.70
16	オリックス不動産投資	日本	投資証券	345,010.67 700 241,507,475	350,000.00 245,000,000	2.26
17	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	203,300.00 1,150 233,795,000	194,500.00 223,675,000	2.07
18	産業ファンド	日本	投資証券	475,000.00 449 213,275,000	486,500.00 218,438,500	2.02
19	いちご不動産投資法人	日本	投資証券	34,092.02 6,000 204,552,179	34,450.00 206,700,000	1.91
20	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	265,500.00 800 212,400,000	257,200.00 205,760,000	1.90
21	平和不動産リート	日本	投資証券	45,798.24 4,700 215,251,772	43,300.00 203,510,000	1.88
22	福岡リート投資法人	日本	投資証券	573,000.00 350 200,550,000	566,000.00 198,100,000	1.83
23	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	35,000.00 5,000 175,000,000	36,500.00 182,500,000	1.69
24	プレミア投資法人	日本	投資証券	292,700.00 500 146,350,000	289,600.00 144,800,000	1.34
25	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	528,000.00 240 126,720,000	511,000.00 122,640,000	1.13
26	野村不レジデンシャル	日本	投資証券	418,000.00 300 125,400,000	390,000.00 117,000,000	1.08
27	M I D リート投資法人	日本	投資証券	210,000.00 472 99,120,000	210,200.00 99,214,400	0.92

28	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	310,500.00 150 46,575,000	328,000.00 49,200,000	0.45
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	401,000.00 100 40,100,000	391,500.00 39,150,000	0.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.75%
合計	96.75%

(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

(1) 投資状況 (平成24年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,485,273,371	71.84
内 カナダ	115,264,600	5.58
内 アメリカ	1,370,008,771	66.27
ハイブリッド優先証券	463,681,734	22.43
内 アメリカ	463,681,734	22.43
投資証券	48,158,314	2.33
内 アメリカ	48,158,314	2.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	70,299,852	3.40
純資産総額	2,067,413,271	100.00

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

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

(2) 投資資産 (平成24年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	7,000	6,546.41 45,824,898	6,297.02 44,079,188	2.13
2	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	5,700	7,953.55 45,335,278	7,704.95 43,918,270	2.12
3	QUALCOMM INC	アメリカ	株式	情報技術	8,800	5,256.46 46,257,563	4,533.95 39,898,795	1.93
4	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	14,800	3,360.57 49,736,906	2,601.20 38,497,807	1.86
5	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消費財 ・サービス	5,300	7,652.87 40,560,224	7,111.48 37,690,850	1.82
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	5,300	6,932.33 36,741,364	6,698.72 35,503,267	1.72
7	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	7,900	4,581.30 36,192,317	4,432.93 35,020,198	1.69
8	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	15,100	2,431.52 36,716,031	2,315.51 34,964,243	1.69
9	CVS CAREMARK CORP	アメリカ	株式	生活必需品	9,200	3,427.49 31,532,960	3,577.44 32,912,481	1.59
10	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	15,900	2,249.22 35,762,598	2,065.33 32,838,849	1.59
11	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	3,400	9,719.78 33,047,276	9,272.31 31,525,857	1.52
12	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	11,500	2,410.21 27,717,493	2,670.65 30,712,507	1.49
13	WALT DISNEY CO	アメリカ	株式	一般消費財 ・サービス	8,500	3,302.80 28,073,817	3,567.18 30,321,064	1.47
14	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・ サービス	5,100	6,278.87 32,022,264	5,888.22 30,029,928	1.45
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,900	16,004.97 30,409,454	15,352.30 29,169,384	1.41
16	FIFTH THIRD CAP TR VI VAR	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	-	14,028	2,005.35 28,131,151	2,000.62 28,064,725	1.36
17	COVIDIEN PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	6,700	4,201.70 28,151,395	4,095.94 27,442,852	1.33
18	ABBOTT LABORATORIES	アメリカ	株式	ヘルスケア	5,200	4,702.84 24,454,783	4,876.46 25,357,627	1.23
19	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	10,100	2,591.73 26,176,501	2,501.76 25,267,816	1.22
20	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	アメリカ	株式	エネルギー	3,900	6,989.94 27,260,783	6,336.48 24,712,299	1.20
21	RAYMOND JAMES 6.9	アメリカ	ハイブリッド 優先証券	-	12,000	2,033.76 24,405,221	2,040.08 24,480,984	1.18

22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	8,200	2,981.59 24,449,100	2,951.60 24,203,186	1.17
23	EMERSON ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	6,400	3,953.10 25,299,858	3,716.34 23,784,594	1.15
24	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	3,500	6,812.37 23,843,310	6,772.12 23,702,438	1.15
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	4,200	5,134.53 21,565,048	5,383.92 22,612,474	1.09
26	BLACKROCK INC	アメリカ	株式	金融	1,655	14,469.42 23,946,980	13,477.16 22,304,714	1.08
27	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	4,500	5,193.72 23,371,763	4,918.29 22,132,325	1.07
28	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	14,700	1,490.00 21,903,141	1,502.63 22,088,761	1.07
29	US BANCORP	アメリカ	株式	金融	9,100	2,438.62 22,191,515	2,426.79 22,083,789	1.07
30	QWEST CORPORATION 7.0	アメリカ	ハイブリッド優先証券	-	10,900	1,996.51 21,762,563	2,015.61 21,970,223	1.06

(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	71.84%
ハイブリッド優先証券	22.43%
投資証券	2.33%
合計	96.60%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	9.84%
素材	1.82%
資本財・サービス	7.37%
一般消費財・サービス	8.38%
生活必需品	7.09%
ヘルスケア	8.34%
金融	11.66%
情報技術	12.21%
電気通信サービス	2.44%
公益事業	2.68%
合計	71.84%

(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) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,753,280,573	96.17
内 ノルウェー	29,672,350	1.63
内 スウェーデン	142,524,312	7.82
内 イギリス	688,480,516	37.77
内 オランダ	136,771,834	7.50
内 ベルギー	9,461,656	0.52
内 フランス	222,194,604	12.19
内 ドイツ	212,593,533	11.66
内 スイス	243,171,952	13.34
内 スペイン	34,339,140	1.88
内 オーストリア	34,070,676	1.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	69,730,494	3.83
純資産総額	1,823,011,067	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	19,985	4,519.08 90,315,448	4,502.91 89,990,696	4.94
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	35,867	2,586.28 92,764,190	2,428.15 87,090,719	4.78
3	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	134,111	663.66 89,013,717	614.82 82,454,641	4.52
4	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信 サービス	354,250	206.85 73,306,907	209.78 74,316,329	4.08
5	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	38,563	1,712.71 66,048,386	1,720.52 66,348,795	3.64
6	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	17,481	3,823.14 66,834,215	3,666.35 64,091,512	3.52
7	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	13,957	4,051.80 56,551,156	4,108.70 57,345,182	3.15

8	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	9,922	5,410.58 53,684,381	5,320.29 52,787,917	2.90
9	BASF SE	ドイツ	株式	素材	8,755	5,983.61 52,386,836	5,543.83 48,536,317	2.66
10	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	59,689	784.92 46,858,316	793.71 47,376,055	2.60
11	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	6,448	7,959.05 51,320,610	7,135.04 46,006,775	2.52
12	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	13,313	3,561.66 47,417,454	3,371.30 44,882,206	2.46
13	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	スウェーデン	株式	一般消費財・サービス	18,627	2,514.03 46,828,974	2,363.13 44,018,134	2.41
14	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	スウェーデン	株式	素材	36,853	1,208.36 44,532,095	1,129.34 41,619,714	2.28
15	KINGFISHER PLC	イギリス	株式	一般消費財・サービス	120,287	363.39 43,717,823	337.38 40,583,622	2.23
16	REXAM PLC	イギリス	株式	素材	81,604	512.25 41,805,400	493.44 40,267,209	2.21
17	BAYER AG	ドイツ	株式	ヘルスケア	8,047	4,934.59 39,708,977	4,989.35 40,149,365	2.20
18	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	2,415	17,509.50 42,285,516	16,264.12 39,277,869	2.15
19	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	46,985	887.61 41,709,165	821.80 38,612,287	2.12
20	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	イギリス	株式	生活必需品	9,215	4,282.03 39,459,248	4,189.59 38,607,110	2.12
21	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	78,630	539.35 42,414,933	486.36 38,242,812	2.10
22	GDF SUEZ	フランス	株式	公益事業	24,237	1,740.85 42,194,074	1,562.89 37,879,915	2.08
23	ATLAS COPCO AB-B SHS	スウェーデン	株式	資本財・サービス	25,047	1,513.44 37,907,164	1,467.71 36,761,782	2.02
24	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	14,706	2,940.60 43,245,662	2,436.10 35,825,391	1.97
25	AKZO NOBEL	オランダ	株式	素材	9,790	4,184.96 40,971,603	3,622.67 35,466,020	1.95
26	SCHNEIDER ELECTRIC SA	フランス	株式	資本財・サービス	8,383	4,479.19 37,549,211	4,229.87 35,459,039	1.95
27	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	5,313	6,985.98 37,116,648	6,570.80 34,910,672	1.92
28	KONINKLIJKE AHOLD NV	オランダ	株式	生活必需品	37,584	997.87 37,504,994	925.73 34,792,653	1.91
29	KON PHILIPS ELECTRONICS NV	オランダ	株式	資本財・サービス	24,479	1,350.37 33,056,549	1,395.96 34,171,852	1.87
30	OESTERREICHISCHE POST AG	オーストリア	株式	資本財・サービス	12,936	2,594.83 33,567,584	2,633.78 34,070,676	1.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.17%
合計	96.17%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	10.23%
素材	13.33%
資本財・サービス	11.85%
一般消費財・サービス	8.11%
生活必需品	12.48%
ヘルスケア	11.88%
金融	15.90%
電気通信サービス	7.21%
公益事業	5.17%
その他	0.01%
合計	96.17%

(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・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,617,482,386	90.17
	内 韓国	416,258,156	23.20
	内 中国	19,102,832	1.06
	内 台湾	281,771,927	15.71
	内 香港	215,575,896	12.02
	内 シンガポール	137,984,061	7.69
	内 オーストラリア	546,789,514	30.48
投資証券		19,280,426	1.07
	内 オーストラリア	19,280,426	1.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		157,087,712	8.76
純資産総額		1,793,850,524	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	1,500	84,829.20 127,243,800	82,019.40 123,029,100	6.86
2	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	33,000	2,638.33 87,065,015	2,462.29 81,255,629	4.53
3	COMMONWEALTH BANK	オーストラリア	株式	金融	18,000	3,840.77 69,133,990	3,807.09 68,527,793	3.82
4	TSMC	台湾	株式	情報技術	300,000	224.98 67,495,500	216.50 64,951,500	3.62
5	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	オーストラリア	株式	金融	40,000	1,758.88 70,355,568	1,605.04 64,201,752	3.58
6	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費財・サービス	3,500	17,260.20 60,410,700	16,256.70 56,898,450	3.17
7	WESFARMERS LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	23,000	2,258.69 51,949,994	2,215.83 50,964,159	2.84
8	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	台湾	株式	電気通信サービス	220,000	165.90 36,500,090	173.04 38,069,900	2.12
9	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	35,000	1,132.01 39,620,525	1,070.82 37,478,875	2.09
10	ORICA LTD	オーストラリア	株式	素材	18,500	2,079.59 38,472,448	1,893.59 35,031,593	1.95
11	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS	香港	株式	情報技術	130,000	255.01 33,152,080	252.47 32,821,880	1.83
12	POSCO	韓国	株式	素材	1,200	25,755.35 30,906,431	24,251.25 29,101,500	1.62
13	CLP HOLDINGS LTD	香港	株式	公益事業	45,000	662.36 29,806,499	640.58 28,826,460	1.61
14	HUTCHISON WHAMPOA LTD	香港	株式	資本財・サービス	40,000	767.08 30,683,200	660.90 26,436,320	1.47
15	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	10,500	2,977.05 31,259,025	2,492.02 26,166,263	1.46
16	SUNCORP GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	44,000	627.62 27,615,632	593.18 26,100,140	1.45
17	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	韓国	株式	生活必需品	650	37,664.70 24,482,055	39,471.00 25,656,150	1.43
18	SINGAPORE TELECOM LTD	シンガポール	株式	電気通信サービス	130,000	190.72 24,798,448	186.62 24,261,835	1.35
19	COCA-COLA AMATIL LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	25,000	950.62 23,765,670	968.99 24,224,910	1.35

20	M1 LTD	シンガポール	株式	電気通信サービス	60,000	151.75 24,284,193	149.91 23,986,480	1.34
21	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	香港	株式	公益事業	55,000	462.31 25,427,597	430.78 23,693,120	1.32
22	CSL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	8,000	2,782.22 22,257,832	2,844.22 22,753,811	1.27
23	LG CHEM LTD	韓国	株式	素材	1,100	24,719.55 27,191,505	19,936.20 21,929,820	1.22
24	TELSTRA CORP LTD	オーストラリア	株式	電気通信サービス	75,000	257.17 19,288,080	272.48 20,436,180	1.14
25	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	4,500	5,047.81 22,715,159	4,389.56 19,753,061	1.10
26	WOODSIDE PETROLEUM LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	8,000	2,660.53 21,284,243	2,462.29 19,698,334	1.10
27	TRANSURBAN GROUP	オーストラリア	株式	資本財・サービス	45,000	442.24 19,903,269	430.92 19,391,409	1.08
28	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	韓国	株式	資本財・サービス	1,500	15,453.90 23,180,850	12,844.80 19,267,200	1.07
29	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	80,000	295.32 23,626,412	235.58 18,846,800	1.05
30	S-OIL CORPORATION	韓国	株式	エネルギー	3,000	6,744.93 20,234,820	6,261.84 18,785,520	1.05

(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	90.17%
投資証券	1.07%
合計	91.24%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	2.15%
素材	15.07%
資本財・サービス	8.19%
一般消費財・サービス	6.56%
生活必需品	6.49%
ヘルスケア	1.27%
金融	22.87%
情報技術	17.43%
電気通信サービス	7.00%
公益事業	3.13%
合計	90.17%

(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

(1) 投資状況（平成24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	21,327,315,100	97.34
内 日本	21,327,315,100	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	583,726,255	2.66
純資産総額	21,911,041,355	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	キヤノン	日本	株式	電気機器	170,000	3,700.00 629,000,000	3,150.00 535,500,000	2.44
2	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,620,000	118.81 548,908,244	115.00 531,300,000	2.42
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	230,000	2,643.00 607,890,000	2,289.00 526,470,000	2.40
4	加藤製作所	日本	株式	機械	1,260,000	390.85 492,471,463	384.00 483,840,000	2.21
5	シンニッタン	日本	株式	鉄鋼	1,076,500	493.00 530,714,500	384.00 413,376,000	1.89
6	住友商事	日本	株式	卸売業	308,000	1,136.95 350,181,800	1,053.00 324,324,000	1.48
7	愛知電機	日本	株式	電気機器	947,000	341.00 322,927,000	337.00 319,139,000	1.46
8	日本デジタル研究所	日本	株式	電気機器	399,100	812.45 324,249,454	781.00 311,697,100	1.42
9	丸紅	日本	株式	卸売業	610,000	538.05 328,212,000	502.00 306,220,000	1.40
10	UKCホールディングス	日本	株式	卸売業	297,000	1,096.50 325,661,164	981.00 291,357,000	1.33
11	ツガミ	日本	株式	機械	438,000	795.86 348,587,143	659.00 288,642,000	1.32

12	M C J	日本	株式	電気機器	2,393,000	148.00 354,164,000	118.00 282,374,000	1.29
13	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	75,000	3,594.26 269,570,194	3,380.00 253,500,000	1.16
14	東燃ゼネラル石油	日本	株式	石油・石炭製品	340,000	745.56 253,492,000	714.00 242,760,000	1.11
15	パイオラックス	日本	株式	金属製品	140,500	2,006.00 281,843,000	1,679.00 235,899,500	1.08
16	T B K	日本	株式	輸送用機器	533,000	501.00 267,033,000	432.00 230,256,000	1.05
17	NECキャピタルソリューション	日本	株式	その他金融業	39,000	1,196.00 285,844,000	956.00 228,484,000	1.04
18	自動車部品	日本	株式	輸送用機器	562,000	506.00 284,372,000	406.00 228,172,000	1.04
19	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	1,800	135,400.00 243,720,000	125,100.00 225,180,000	1.03
20	住友ゴム	日本	株式	ゴム製品	230,000	1,103.20 253,738,000	950.00 218,500,000	1.00
21	日立機材	日本	株式	金属製品	360,900	606.21 218,783,995	605.00 218,344,500	1.00
22	小松製作所	日本	株式	機械	116,000	2,288.80 265,501,752	1,878.00 217,848,000	0.99
23	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	70,000	3,270.00 228,900,000	3,040.00 212,800,000	0.97
24	ネットワンシステムズ	日本	株式	情報・通信業	94,000	1,015.14 196,938,524	1,084.00 210,296,000	0.96
25	藤森工業	日本	株式	化学	146,000	1,355.16 197,853,590	1,387.00 202,502,000	0.92
26	メディカルシステムネットワーク	日本	株式	小売業	396,000	659.50 261,162,000	511.00 202,356,000	0.92
27	日本ピラ - 工業	日本	株式	機械	296,000	681.00 201,576,000	675.00 199,800,000	0.91
28	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	584,000	388.00 226,592,000	340.00 198,560,000	0.91
29	セブテーニHLDGS	日本	株式	サービス業	3,795	66,014.19 250,523,871	51,100.00 193,924,500	0.89
30	G M B	日本	株式	輸送用機器	173,500	1,420.00 246,370,000	1,105.00 191,717,500	0.87

(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	97.34%
合計	97.34%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	2.92%

食料品	0.08%
繊維製品	1.12%
パルプ・紙	0.62%
化学	3.68%
医薬品	1.00%
石油・石炭製品	1.30%
ゴム製品	2.49%
ガラス・土石製品	0.88%
鉄鋼	3.76%
非鉄金属	1.70%
金属製品	5.20%
機械	11.53%
電気機器	10.60%
輸送用機器	10.19%
その他製品	2.08%
電気・ガス業	0.18%
陸運業	1.87%
海運業	0.96%
倉庫・運輸関連業	0.93%
情報・通信業	6.77%
卸売業	8.07%
小売業	2.12%
銀行業	7.89%
保険業	0.66%
その他金融業	1.48%
不動産業	3.64%
サービス業	3.61%
合計	97.34%

(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。

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24年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,389,925,506	99.29
内 日本	2,389,925,506	99.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,007,074	0.71
純資産総額	2,406,932,580	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,465,096,500 1,719,730,294	1.1738	1.1484 1,682,516,820	69.90
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	236,170,121 257,590,750	1.0907	1.0036 237,020,333	9.85
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	125,825,282 123,447,185	0.9811	0.9643 121,333,319	5.04
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	131,693,507 123,594,360	0.9385	0.8856 116,627,769	4.85
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	75,498,539 87,042,265	1.1529	1.0675 80,594,690	3.35
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	86,380,140 79,858,443	0.9245	0.8936 77,189,293	3.21
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	107,803,701 80,777,313	0.7493	0.6924 74,643,282	3.10

(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	99.29%
合計	99.29%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第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
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
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
平成23年5月末日	3,762,148,273	-	0.6994	-
6月末日	3,646,644,222	-	0.6935	-
7月末日	3,384,994,464	-	0.6701	-
8月末日	3,303,855,773	-	0.6636	-
9月末日	3,047,360,090	-	0.6275	-
10月末日	3,090,064,063	-	0.6489	-
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	2,985,375,195	3,020,666,625	0.6344	0.6419
11月末日	2,868,955,235	-	0.6194	-
12月末日	2,828,720,825	-	0.6282	-
平成24年1月末日	2,772,388,765	-	0.6287	-
2月末日	2,875,950,100	-	0.6774	-
3月末日	2,798,502,465	-	0.6777	-
4月末日	2,735,708,611	-	0.6713	-
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	2,635,394,990	2,655,696,722	0.6491	0.6541
5月末日	2,406,932,580	-	0.6275	-

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
第12特定期間	0.0225
第13特定期間	0.0200

(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
第12特定期間	5.1
第13特定期間	5.5

(4) 設定及び解約の実績

	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
第12特定期間	38,330,975	799,518,890
第13特定期間	25,529,761	670,707,349

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(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）

(1) 投資状況（平成24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	8,541,209,720	99.30

内 日本	8,541,209,720	99.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	60,514,588	0.70
純資産総額	8,601,724,308	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,958,736,578 3,227,094,000	1.0907	1.0036 2,969,388,029	34.52
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	1,513,785,645 1,776,881,595	1.1738	1.1484 1,738,431,434	20.21
3	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,131,705,061 1,046,261,365	0.9245	0.8936 1,011,291,642	11.76
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	935,252,108 1,078,252,155	1.1529	1.0675 998,381,625	11.61
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,393,038,879 1,045,804,033	0.7493	0.6924 964,540,119	11.21
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	455,045,426 446,445,077	0.9811	0.9643 438,800,304	5.10
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	474,679,954 445,487,141	0.9385	0.8856 420,376,567	4.89

(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	99.30%
合計	99.30%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
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
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
平成23年5月末日	12,611,520,630	-	0.6342	-
6月末日	12,221,755,567	-	0.6320	-
7月末日	11,582,443,340	-	0.6138	-
8月末日	10,759,910,107	-	0.5804	-
9月末日	10,014,812,528	-	0.5511	-
10月末日	10,290,873,566	-	0.5781	-
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	9,751,516,113	9,822,135,392	0.5523	0.5563
11月末日	9,440,350,766	-	0.5421	-
12月末日	9,424,496,640	-	0.5527	-
平成24年1月末日	9,419,163,396	-	0.5663	-
2月末日	10,049,647,472	-	0.6190	-
3月末日	10,066,058,268	-	0.6318	-
4月末日	9,719,645,731	-	0.6183	-
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	9,250,480,800	9,313,005,488	0.5918	0.5958
5月末日	8,601,724,308	-	0.5576	-

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
第12特定期間	0.0120
第13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
第12特定期間	11.5
第13特定期間	9.3

(4) 設定及び解約の実績

	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
第12特定期間	60,003,410	2,703,995,028
第13特定期間	55,178,530	2,078,826,213

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(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。

[次へ](#)

(参考情報)

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2012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	7,397円
純資産総額	24億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-4.2%
3か月間	-3.7%
6か月間	3.9%
1年間	-2.6%
3年間	6.0%
5年間	-15.6%
設定来	-1.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において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: 420円 設定来分配金合計額: 2,560円

決算期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	10年7月	10年9月	10年11月	11年1月	11年3月	11年5月	11年7月	11年9月	11年11月	12年1月	12年3月	12年5月
分配金	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円	70円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

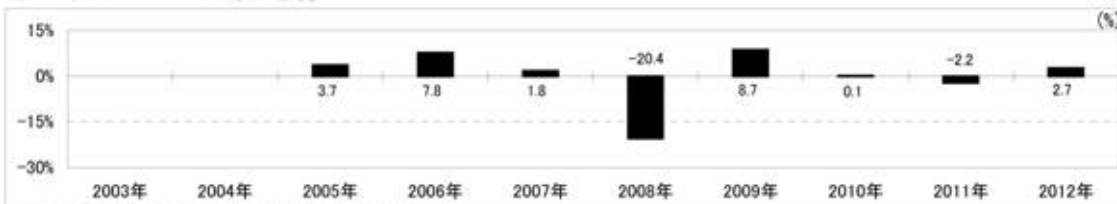
資産別構成		銘柄数		比率		通貨別構成		比率		債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄		国・地域名		比率	
国内債券	43	35.7%	日本円	51.2%	直接利回り(%)	3.8	キヤノン	日本	0.2%								
外国債券	27	34.3%	米ドル	14.8%	最終利回り(%)	1.3	みずほフィナンシャルG	日本	0.2%								
国内株式	195	9.0%	ユーロ	9.3%	修正デュレーション	7.3	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%								
外国株式	207	8.0%	英ポンド	6.2%	残存年数	9.0	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%								
外国リート等	152	5.4%	豪ドル	5.9%	債券格付別構成	比率	加藤製作所	日本	0.2%								
国内リート	29	4.8%	カナダドル	5.8%	AAA	45.2%	日本ビルファンド	日本	0.7%								
			スウェーデン・クローネ	1.4%	AA	52.9%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%								
			ポーランド・ズロチ	1.4%	A	1.9%	日本リテールファンド	日本	0.3%								
			ノルウェー・クローネ	1.0%	BBB	-	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	0.3%								
コール・ローン、その他	2.8%	その他	3.0%	BB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%									
合計	653	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.2%									

※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。

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、2012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。

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2012年5月31日現在
基準価額・純資産の推移

※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	6,275円
純資産総額	24億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-5.8%
3カ月間	-5.6%
6カ月間	4.5%
1年間	-4.3%
3年間	3.6%
5年間	-23.0%
設定来	-4.3%



※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: 425円 設定来分配金合計額: 3,505円

決算期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	10年7月	10年9月	10年11月	11年1月	11年3月	11年5月	11年7月	11年9月	11年11月	12年1月	12年3月	12年5月
分配金	100円	100円	100円	100円	100円	100円	75円	75円	75円	75円	75円	50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。

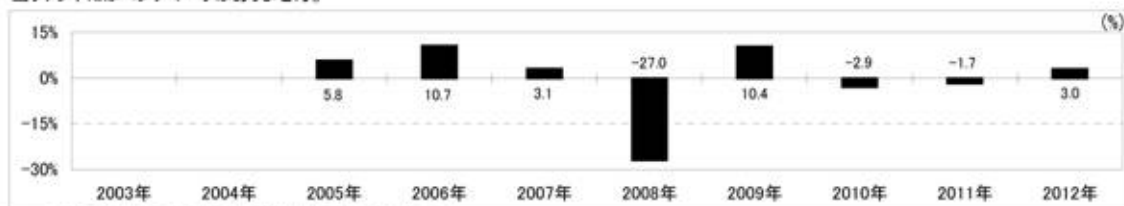
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	27	68.2%	米ドル	24.3%	直接利回り(%)	キヤノン	日本	0.2%	
国内株式	195	9.6%	ユーロ	17.0%	最終利回り(%)	みずほフィナンシャルG	日本	0.2%	
外国株式	207	8.3%	日本円	16.1%	修正デュレーション	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%	
外国リート等	152	5.6%	カナダドル	11.3%	残存年数	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.2%	
国内リート	29	4.9%	英ポンド	10.9%	債券格付別構成	加藤製作所	日本	0.2%	
			豪ドル	9.9%	AAA	92.4%	日本ビルファンド	日本	0.7%
			ポーランド・ズロチ	2.8%	AA	3.7%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			スウェーデン・クローネ	2.6%	A	3.9%	日本リートファンド	日本	0.3%
			ノルウェー・クローネ	1.9%	BBB	-	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	0.3%
コール・ローン、その他		3.4%	その他	3.3%	BB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
合計	610	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	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。

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、2012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)

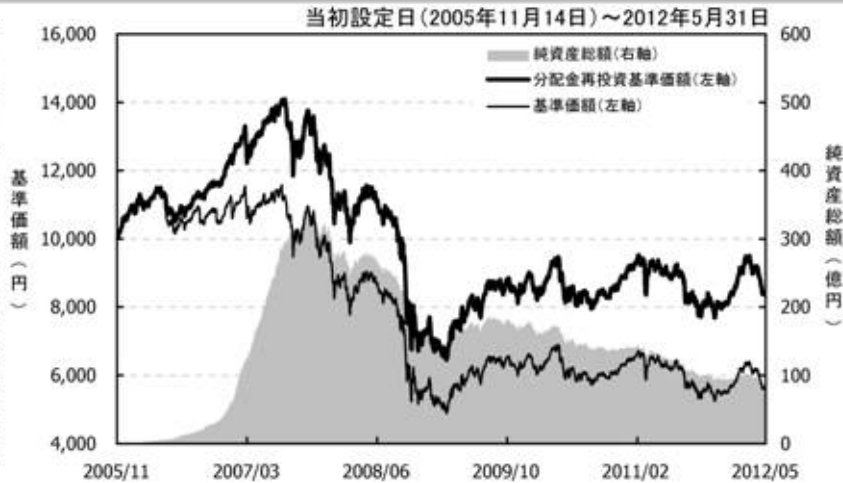
2012年5月31日現在

※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	5,576円
純資産総額	86億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-9.2%
3カ月間	-8.7%
6カ月間	5.0%
1年間	-8.4%
3年間	4.5%
5年間	-38.8%
設定来	-16.6%



※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: 3,610円

決算期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	10年7月	10年9月	10年11月	11年1月	11年3月	11年5月	11年7月	11年9月	11年11月	12年1月	12年3月	12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。

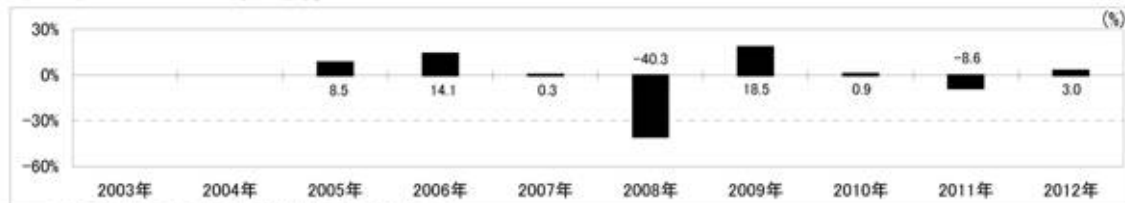
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	195	33.6%	日本円	40.9%	直接利回り(%)	キヤノン	日本	0.8%	
外国株式	207	29.7%	米ドル	18.9%	最終利回り(%)	みずほフィナンシャルG	日本	0.8%	
外国債券	27	19.7%	ユーロ	9.1%	修正デュレーション	三井住友フィナンシャルG	日本	0.8%	
外国リート等	152	7.8%	英ポンド	7.5%	残存年数	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.8%	
国内リート	29	4.9%	豪ドル	7.0%	債券格付別構成	加藤製作所	日本	0.8%	
			カナダドル	4.0%	AAA	92.4%	日本ビルファンド	日本	0.7%
			韓国ウォン	2.8%	AA	3.7%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
			台湾ドル	1.9%	A	3.9%	日本リテールファンド	日本	0.3%
			香港ドル	1.7%	BBB	-	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	0.3%
コール・ローン、その他		4.2%	その他	6.2%	BB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
合計	610	100.0%	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。

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、2012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。

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 1 財務諸表」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、当特定期間（平成23年11月11日から平成24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23年11月10日現在	平成24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	24,808,076	23,815,791
親投資信託受益証券	2,789,818,828	2,543,320,733
未収入金	34,000,000	23,000,000
流動資産合計	2,848,626,904	2,590,136,524
資産合計	2,848,626,904	2,590,136,524
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	26,434,293	23,641,775
未払解約金	6,119,673	-
未払受託者報酬	243,438	225,912
未払委託者報酬	5,599,332	5,196,229
その他未払費用	121,776	105,432
流動負債合計	38,518,512	29,169,348
負債合計	38,518,512	29,169,348
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,776,327,573	3,377,396,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 966,219,181	816,429,286
(分配準備積立金)	105,410,816	96,310,527
元本等合計	2,810,108,392	2,560,967,176
純資産合計	2,810,108,392	2,560,967,176
負債純資産合計	2,848,626,904	2,590,136,524

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成23年5月11日 至平成23年11月10日	自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	12,073	10,327
有価証券売買等損益	115,788,119	141,751,905
営業収益合計	115,776,046	141,762,232
営業費用		
受託者報酬	812,397	703,495
委託者報酬	1	16,181,291
その他費用	121,776	105,432
営業費用合計	19,620,342	16,990,218
営業利益又は営業損失()	135,396,388	124,772,014
経常利益又は経常損失()	135,396,388	124,772,014
当期純利益又は当期純損失()	135,396,388	124,772,014
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()	4,011,675	3,611,372
期首剰余金又は期首欠損金()	839,934,027	966,219,181
剰余金増加額又は欠損金減少額	94,467,685	108,219,864
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	94,467,685	108,219,864
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,452,380	6,164,673
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	7,452,380	6,164,673
分配金	2	81,915,746
分配金		73,425,938
期末剰余金又は期末欠損金()	966,219,181	816,429,286

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期 自平成23年11月11日 至平成24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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
1. 1 期首元本額	4,180,792,752円	3,776,327,573円
期中追加設定元本額	34,639,493円	25,669,129円
期中一部解約元本額	439,104,672円	424,600,240円
2. 特定期間末日における受益権の総数	3,776,327,573口	3,377,396,462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966,219,181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816,429,286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23年5月11日 至平成23年11月10日	当期 自平成23年11月11日 至平成24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	713,768円	680,034円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成23年5月11日 至平成23年7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（14,795,173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（114,128,983円）及び分配準備積立金（113,606,335円）より分配対象額は242,530,491円（1万口当たり602.43円）であり、うち28,180,925円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	（自平成23年11月11日 至平成24年1月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,807,500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（65,931,233円）及び分配準備積立金（101,767,221円）より分配対象額は177,505,954円（1万口当たり485.96円）であり、うち25,568,595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23年7月12日 至平成23年9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(13,078,135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(97,318,377円)及び分配準備積立金(110,345,309円)より分配対象額は220,741,821円(1万口当たり565.99円)であり、うち27,300,528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9月13日 至平成23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(12,498,229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(81,177,546円)及び分配準備積立金(106,129,734円)より分配対象額は199,805,509円(1万口当たり529.10円)であり、うち26,434,293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24年1月11日 至平成24年3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(15,173,125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(50,508,166円)及び分配準備積立金(93,393,720円)より分配対象額は159,075,011円(1万口当たり459.84円)であり、うち24,215,568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24年3月13日 至平成24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(14,288,293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(37,837,826円)及び分配準備積立金(93,843,122円)より分配対象額は145,969,241円(1万口当たり432.19円)であり、うち23,641,775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	当期 自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期 平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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	13,869,885	42,071,003
合計	13,869,885	42,071,003

（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23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期 自 平成23年11月11日 至 平成24年5月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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)	0.7441円 (7,441円)	0.7583円 (7,583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	761,063,021	893,335,774	
	ダイワ日本国債マザーファンド	792,895,946	907,469,410	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	131,673,689	123,575,757	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	126,777,049	124,380,962	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	88,342,535	81,672,673	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	104,720,999	78,467,444	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	74,086,415	85,414,227	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	228,297,870	249,004,486	
親投資信託受益証券 合計			2,543,320,733	
合計			2,543,320,733	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	-	256,374,889
コール・ローン	533,804,042	39,849,652
国債証券	89,792,027,507	71,939,084,142
特殊債券	11,957,612,751	9,433,459,732
派生商品評価勘定	10,937,550	15,495,385
未収入金	2,482,114,275	8,876,787,492
未収利息	1,665,671,914	1,203,709,450
前払費用	349,955,977	606,292,366
流動資産合計	106,792,124,016	92,371,053,108
資産合計	106,792,124,016	92,371,053,108
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,128,263
前受金	315,785,572	-
未払金	1,128,232,469	8,015,974,167
未払解約金	609,077,000	132,150,000
流動負債合計	2,053,095,041	8,151,252,430
負債合計	2,053,095,041	8,151,252,430
純資産の部		
元本等		
元本	1	92,520,635,939
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,218,393,036
元本等合計		104,739,028,975
純資産合計		84,219,800,678
負債純資産合計		92,371,053,108

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23年11月11日 至 平成24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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
<p>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</p>	121,223,251,254円	92,520,635,939円
<p>同期中における追加設定元本額</p>	42,240,907円	44,804,174円
<p>同期中における一部解約元本額</p>	28,744,856,222円	20,816,001,405円
<p>同期末における元本の内訳 ファンド名</p>		
<p>ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）</p>	9,444,407,411円	7,784,361,116円
<p>富山応援ファンド（地域企業株・外債バランスノ毎月分配型）</p>	2,132,272,316円	1,763,547,120円
<p>北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型）</p>	2,601,262,877円	2,321,330,617円
<p>福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型）</p>	1,110,747,977円	881,534,669円
<p>ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）</p>	5,256,159,413円	3,987,006,992円
<p>ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）</p>	70,923,728円	66,887,263円
<p>ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）</p>	90,876,537円	85,785,200円
<p>新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型）</p>	1,252,095,659円	1,097,712,752円
<p>安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	882,305,511円	761,063,021円
<p>インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	1,865,932,753円	1,577,290,475円
<p>成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	1,753,426,570円	1,585,912,227円
<p>FITネット・三県応援ファンド（毎月分配型）</p>	1,067,688,156円	856,619,888円
<p>長野応援ファンド（毎月分配型）</p>	795,320,984円	686,959,386円
<p>安定重視ポートフォリオ（資産形成型）</p>	17,159,133円	13,908,088円

インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	52,114,538円	45,349,732円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	39,940,587円	35,954,851円
栃木応援・外債バランスファンド(毎月分配型)	1,141,193,785円	942,413,989円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	760,315,790円	672,174,504円
北東北三県応援・外債バランスファンド(毎月分配型)	1,104,265,306円	882,512,203円
6資産バランスファンド(分配型)	4,140,162,385円	3,494,224,216円
6資産バランスファンド(成長型)	275,063,669円	265,906,998円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	42,341,081,675円	29,859,262,696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)	681,831,821円	635,321,323円
奈良応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	300,811,826円	234,447,456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)	771,372,391円	690,419,277円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	483,266,348円	343,854,531円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	4,009,242,268円	3,278,408,080円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	411,319,350円	352,678,694円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	93,005,185円	78,719,177円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	1,068,007,244円	888,685,603円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	345,642,009円	311,598,921円
愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	729,392,974円	522,533,502円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	4,984,975,076円	4,397,776,471円
地球環境株・外債バランス・ファンド	425,011,997円	333,755,532円
ダイワ円債重視バランスファンド(奇数月決算型)	1,876,613円	-円
ダイワ円債重視バランスファンド(資産形成型)	91,575円	-円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	20,072,502円	13,522,138円
計	92,520,635,939円	71,749,438,708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	92,520,635,939円	71,749,438,708円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
----	-----------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、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。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成23年11月10日現在	平成24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	1,431,933,291	787,069,951
特殊債券	4,216,335	346,753,148
合計	1,436,149,626	1,133,823,099

（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23年10月12日から平成23年11月10日まで、及び平成24年4月11日から平成24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23年11月10日 現在				平成24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	611,090,550	-	600,153,000	10,937,550	6,301,898,452	-	6,293,011,580	8,886,872
オーストラリア・ ドル	-	-	-	-	1,814,919,602	-	1,808,331,580	6,588,022
スウェーデン・ クローナ	-	-	-	-	174,218,850	-	173,700,000	518,850
ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	2,146,190,000	-	2,144,620,000	1,570,000
ユーロ	611,090,550	-	600,153,000	10,937,550	2,166,570,000	-	2,166,360,000	210,000
買 建	-	-	-	-	5,741,032,000	-	5,744,512,250	3,480,250
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	4,312,760,000	-	4,315,788,117	3,028,117
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,428,272,000	-	1,428,724,133	452,133
合計	611,090,550	-	600,153,000	10,937,550	12,042,930,452	-	12,037,523,830	12,367,122

(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23年11月10日現在	平成24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)	1.1321円 (11,321円)	1.1738円 (11,738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	9% U.S. TREASURY BOND 20181115	アメリカ・ドル 16,000,000.000	アメリカ・ドル 24,032,480.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	53,700,000.000	83,142,636.000	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	102,700,000.000	160,090,814.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 267,265,930.000 (21,306,439,939)	
	イギリス・ポンド	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	イギリス・ポンド 34,000,000.000	イギリス・ポンド 51,992,800.000	
		イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 51,992,800.000 (6,690,433,504)	
	オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	オーストラリア・ドル 11,000,000.000	オーストラリア・ドル 13,120,030.000	
		オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 13,120,030.000 (1,052,751,207)	
	カナダ・ドル	9.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	カナダ・ドル 10,000,000.000	カナダ・ドル 16,568,500.000	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	14,500,000.000	23,010,340.000	
		9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	37,600,000.000	66,776,472.000	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	20,800,000.000	35,920,976.000	
		5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	18,000,000.000	18,768,420.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 161,044,708.000 (12,819,158,757)	
	スウェーデン・クローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	スウェーデン・クローナ 220,000,000.000	スウェーデン・クローナ 244,479,400.000	
		5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	50,000,000.000	63,939,000.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 308,418,400.000 (3,574,569,256)	
	チェコ・コルナ	6.95% Czech Republic Government Bond 20160126	チェコ・コルナ 64,000,000.000	チェコ・コルナ 75,452,160.000	
		チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 75,452,160.000 (308,599,334)	
	デンマーク・クローネ	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	デンマーク・クローネ 2,200,000.000	デンマーク・クローネ 2,359,764.000	

デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 2,359,764.000 (32,753,524)	
ノルウェー・クローネ	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	ノルウェー・クローネ 146,500,000.000	ノルウェー・クローネ 153,772,260.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	70,000,000.000	80,276,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 234,048,260.000 (3,199,439,715)	
ポーランド・ズロチ	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	ポーランド・ズロチ 156,500,000.000	ポーランド・ズロチ 163,580,060.000	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	50,000,000.000	50,198,000.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 213,778,060.000 (5,205,495,761)	
ユーロ	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	ユーロ 26,000,000.000	ユーロ 41,226,640.000	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	30,000,000.000	36,234,600.000	
	4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	50,000,000.000	53,148,000.000	
	6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	30,000,000.000	41,431,500.000	
ユーロ 小計			ユーロ 172,040,740.000 (17,749,443,145)	
国債証券 合計			71,939,084,142 [71,939,084,142]	
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 15,000,000.000	オーストラリア・ドル 16,574,400.000
		6% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20200820	35,000,000.000	38,167,850.000
		6% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20210614	30,000,000.000	34,266,300.000
		6.25% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20190614	25,000,000.000	28,557,000.000
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 117,565,550.000 (9,433,459,732)
特殊債券 合計			9,433,459,732 [9,433,459,732]	
合計			81,372,543,874 [81,372,543,874]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 3銘柄	100%	26.2%
イギリス・ポンド	国債証券 1銘柄	100%	8.2%

オーストラリア・ドル	国債証券 特殊債券	1銘柄 4銘柄	100%	12.9%
カナダ・ドル	国債証券	5銘柄	100%	15.8%
スウェーデン・クローナ	国債証券	2銘柄	100%	4.4%
チェコ・コルナ	国債証券	1銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	1銘柄	100%	0.0%
ノルウェー・クローネ	国債証券	2銘柄	100%	3.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券	2銘柄	100%	6.4%
ユーロ	国債証券	4銘柄	100%	21.8%

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23年11月10日現在	平成24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	2,173,869,831	143,764,621
国債証券	184,326,073,989	257,583,923,937
未収入金	-	279,557,500
未収利息	825,538,944	1,155,675,135
前払費用	105,612,213	74,763,402
流動資産合計	187,431,094,977	259,237,684,595
資産合計	187,431,094,977	259,237,684,595
負債の部		
流動負債		
未払金	1,369,324,600	-
未払解約金	12,500,374	306,357,440
流動負債合計	1,381,824,974	306,357,440
負債合計	1,381,824,974	306,357,440
純資産の部		
元本等		
元本	164,650,681,050	226,247,203,255
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,398,588,953	32,684,123,900
元本等合計	186,049,270,003	258,931,327,155
純資産合計	186,049,270,003	258,931,327,155
負債純資産合計	187,431,094,977	259,237,684,595

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23年11月11日 至 平成24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。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	111,321,162,408円	164,650,681,050円
同期中における追加設定元本額	56,845,268,178円	70,480,678,192円
同期中における一部解約元本額	3,515,749,536円	8,884,155,987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V A（適格機関投資家専用）	9,466,706円	18,698,132円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	884,242,612円	792,895,946円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	16,895,825円	14,466,975円
6資産バランスファンド（分配型）	831,022,378円	725,154,847円
6資産バランスファンド（成長型）	268,219,777円	259,338,782円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	161,983,139,282円	222,934,800,502円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	481,831,563円	349,618,165円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	142,902,815円	129,224,405円
ダイワ日本国債三分法（四半期分配型）	32,960,092円	39,911,844円
ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol.4 - 日本の真価 -（国債コース）	- 円	983,093,657円
計	164,650,681,050円	226,247,203,255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	164,650,681,050口	226,247,203,255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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成23年11月10日現在	平成24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	1,058,078,993	798,917,004
合計	1,058,078,993	798,917,004

(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23年3月11日から平成23年11月10日まで、及び平成24年3月13日から平成24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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年11月10日現在	平成24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)	1.1300円 (11,300円)	1.1445円 (11,445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 9 利付国債2 0 年	9,317,000,000	9,507,532,650	
	2 0 利付国債2 0 年	2,820,000,000	2,874,679,800	
	2 1 利付国債2 0 年	2,210,000,000	2,314,908,700	
	2 2 利付国債2 0 年	2,275,000,000	2,375,282,000	
	2 3 利付国債2 0 年	10,399,000,000	11,157,191,089	
	2 4 利付国債2 0 年	5,429,000,000	5,889,433,490	
	2 7 利付国債2 0 年	7,576,000,000	8,447,618,800	
	2 8 利付国債2 0 年	7,708,000,000	8,778,564,120	
	2 9 利付国債2 0 年	7,340,000,000	8,336,845,399	
	3 0 利付国債2 0 年	47,000,000	52,606,630	
	3 2 利付国債2 0 年	7,593,000,000	8,622,003,360	
	3 3 利付国債2 0 年	8,774,000,000	10,137,216,380	
	3 4 利付国債2 0 年	6,184,000,000	7,155,506,400	
	3 6 利付国債2 0 年	1,270,000,000	1,452,194,200	
	3 7 利付国債2 0 年	6,033,000,000	6,930,288,090	
	3 8 利付国債2 0 年	7,616,000,000	8,649,262,720	
4 0	2 0 年国債	5,612,000,000	6,274,552,720	

4 2	2 0 年国債	9,478,000,000	10,831,932,300
4 3	2 0 年国債	11,297,000,000	13,219,975,340
4 4	2 0 年国債	3,595,000,000	4,117,820,850
4 7	2 0 年国債	4,000,000,000	4,494,920,000
4 8	2 0 年国債	7,031,000,000	8,084,454,729
4 9	2 0 年国債	3,988,000,000	4,455,353,720
5 1	2 0 年国債	230,000,000	254,718,100
5 2	2 0 年国債	6,318,000,000	7,054,426,080
5 4	2 0 年国債	3,477,000,000	3,916,318,950
5 5	2 0 年国債	5,374,000,000	5,954,714,440
5 6	2 0 年国債	4,130,000,000	4,573,933,700
5 8	2 0 年国債	11,455,000,000	12,575,528,100
5 9	2 0 年国債	95,000,000	102,306,450
6 3	2 0 年国債	3,818,000,000	4,143,866,300
6 4	2 0 年国債	7,125,000,000	7,798,668,750
6 5	2 0 年国債	27,000,000	29,526,120
6 8	2 0 年国債	4,645,000,000	5,229,944,850
7 0	2 0 年国債	6,338,000,000	7,276,214,140
7 4	2 0 年国債	6,000,000,000	6,671,460,000
7 5	2 0 年国債	2,950,000,000	3,276,565,000
8 0	2 0 年国債	3,833,000,000	4,249,992,070
8 2	2 0 年国債	4,335,000,000	4,797,804,600
8 3	2 0 年国債	3,070,000,000	3,393,086,800
8 6	2 0 年国債	4,200,000,000	4,743,018,000
8 8	2 0 年国債	2,420,000,000	2,729,518,000
9 1	2 0 年国債	13,000,000,000	14,652,170,000
国債証券 合計			257,583,923,937
合計			257,583,923,937

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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	966,172,454	3,288,556,204
コール・ローン	4,123,999,941	3,112,579,759
投資証券	399,538,303,615	293,126,368,444
派生商品評価勘定	21,127,072	4,190,549
未収入金	7,225,163,934	3,283,558,517
未収配当金	698,257,520	1,794,297,387
流動資産合計	412,573,024,536	304,609,550,860
資産合計	412,573,024,536	304,609,550,860
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,931,006	1,398,155
未払金	319,723,776	223,387,947
未払解約金	4,085,701,000	3,181,100,000
流動負債合計	4,408,355,782	3,405,886,102
負債合計	4,408,355,782	3,405,886,102
純資産の部		
元本等		
元本	1 501,144,385,526	320,929,771,290
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 92,979,716,772	19,726,106,532
元本等合計	408,164,668,754	301,203,664,758
純資産合計	408,164,668,754	301,203,664,758
負債純資産合計	412,573,024,536	304,609,550,860

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23年11月11日 至 平成24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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として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。

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成23年11月10日現在	平成24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	594,500,161,580円	501,144,385,526円
同期中における追加設定元本額	40,494,107,606円	600,521,079円
同期中における一部解約元本額	133,849,883,660円	180,815,135,315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）	471,430,500,305円	298,239,280,228円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	124,160,128円	107,808,624円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	165,314,989円	131,673,689円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	177,017,377円	137,117,832円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	588,581,912円	482,848,428円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,151,584円	2,450,807円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	4,787,612円	4,034,356円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	13,379,463円	10,900,256円
6資産バランスファンド（分配型）	1,125,648,116円	874,753,506円
6資産バランスファンド（成長型）	1,570,566,493円	1,309,237,175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）	106,066,922円	87,454,002円
りそな ワールド・リート・ファンド	18,312,414,841円	13,263,603,411円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	657,853,250円	439,687,522円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	31,457,659円	24,653,258円

常陽3分法ファンド	2,154,019,610円	1,709,721,268円
ダイワ資産分散インカムオープン （奇数月決算型）	480,874,143円	394,472,638円
ダイワ・海外株式&REITファ ンド（毎月分配型）	116,173,442円	99,326,441円
ダイワ円債重視バランスファンド （奇数月決算型）	1,300,931円	- 円
ダイワ円債重視バランスファンド （資産形成型）	63,368円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/安定コース）	163,325,212円	160,272,709円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/6分散コース）	176,471,571円	175,149,173円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽/成長コース）	152,825,401円	157,306,114円
ダイワ・グローバルREITファ ンド（ダイワSMA専用）	1,469,237,103円	1,506,440,777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）	2,119,194,094円	1,611,579,076円
計	501,144,385,526円	320,929,771,290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	501,144,385,526口	320,929,771,290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92,979,716,772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19,726,106,532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23年11月11日 至平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金、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。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成23年11月10日現在	平成24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	6,543,435,267	5,617,336,286
合計	6,543,435,267	5,617,336,286

(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23年9月16日から平成23年11月10日まで、及び平成24年3月16日から平成24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23年11月10日 現在				平成24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	4,472,632,412	-	4,457,014,401	15,618,011	3,559,235,505	-	3,555,101,845	4,133,660
アメリカ・ドル	2,722,073,000	-	2,724,400,000	2,327,000	2,925,450,730	-	2,921,751,265	3,699,465
イギリス・ポンド	1,143,041,185	-	1,131,529,460	11,511,725	388,607,937	-	388,204,543	403,394
オーストラリア・ドル	444,596,693	-	441,468,226	3,128,467	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	245,176,838	-	245,146,037	30,801
ユーロ	162,921,534	-	159,616,715	3,304,819	-	-	-	-

買建	1,750,559,412	-	1,753,137,467	2,578,055	765,865,005	-	764,523,739	1,341,266
アメリカ・ドル	1,750,559,412	-	1,753,137,467	2,578,055	633,784,775	-	633,004,998	779,777
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	132,080,230	-	131,518,741	561,489
合計	6,223,191,824	-	6,210,151,868	18,196,066	4,325,100,510	-	4,319,625,584	2,792,394

(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23年11月10日現在	平成24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)	0.8145円 (8,145円)	0.9385円 (9,385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	AVALONBAY COMMUNITIES INC	252,397	36,983,732.410	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,383,573	214,066,414.560	
		BOSTON PROPERTIES INC	688,214	74,203,233.480	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	2,171,253	60,208,845.690	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,180,258	57,022,025.940	
		VORNADO REALTY TRUST	1,230,113	108,040,824.790	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,275,333	80,511,772.290	
		LASALLE HOTEL 7.5 H	250,000	6,345,000.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	3,052,551	48,749,239.470	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	794,745	20,901,793.500	
		HUDSON PACIFIC PROP B	100,000	2,588,000.000	
		KIMCO REALTY CORP	1,533,125	29,957,262.500	
		KIMCO REALTY 6.90% H	542,615	14,650,605.000	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	433,191	22,703,540.310	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	752,818	17,969,765.660
VENTAS INC	1,033,011	60,782,367.240
ASSOCIATED ESTATES REALTY	1,039,999	17,669,583.010
PROLOGIS INC	2,211,668	76,501,596.120
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	386,724	29,000,432.760
BRE PROPERTIES-CL A	202,164	10,621,696.560
MACK-CALI REALTY CORP	646,642	18,713,819.480
FEDERAL REALTY INVS TRUST	448,058	45,401,717.140
HCP INC	1,683,709	69,099,417.360
KILROY REALTY CORP	413,795	20,102,161.100
LIBERTY PROPERTY TRUST	523,901	19,111,908.480
MID-AMERICA APARTMENT COM	165,538	11,508,201.760
EQUITY LIFESTYLE PROPRTI	276,858	19,283,159.700
PUBLIC STORAGE	464,097	64,639,430.160
REGENCY CENTERS CORP	718,569	34,052,984.910
SL GREEN REALTY CORP	757,875	61,403,032.500
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,333,495	28,923,506.550
TAUBMAN CENTERS INC	366,600	28,393,170.000
UDR INC	721,733	19,443,487.020
DDR CORP 7.375 H	375,076	9,451,915.200
SL GREEN REALTY 7.625% C	924,430	23,628,430.800
DDR CORP 7.5 I	268,800	6,754,944.000
SL GREEN REALTY 7.875% D	224,176	5,714,246.240
APARTMENT INVEST 8% T	198,900	5,093,829.000
APARTMENT INVEST 7.75% U	879,895	22,314,137.200
PROLOGIS TRUST 6.75% R	327,570	8,192,525.700
KIMCO REALTY 7.75% G	412,188	10,539,647.160
DUKE REALTY CORP 8.375 O	285,032	7,521,994.480
APARTMENT INVEST 8% V	208,835	5,323,204.150
CUBESMART	2,246,732	27,499,999.680
DIGITAL REALTY TRUST INC	372,878	27,402,804.220
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,477,945	18,954,800.250
CBL&ASSOC PROP 7.375% D	487,166	12,300,941.500
VORNADO RLTY TST 6.625% G	293,814	7,433,494.200
EDUCATION REALTY TRUST	1,714,714	19,564,886.740
SUNSTONE HOTEL 8% A	208,950	5,198,676.000
CEDAR REALTY 8.875 A	260,000	6,528,600.000
DIAMONDROCK HOSPITALITY	3,567,379	37,921,238.770
VORNADO REALTY TST 6.75%F	381,527	9,641,187.290
LASALLE HOTEL 8% E	110,337	2,780,492.400
VORNADO RLTY TST 6.625% I	503,498	12,718,359.480
DUKE REALTY CORP 6.60% L	807,113	20,452,243.420
DOUGLAS EMMETT	447,520	10,409,315.200
LASALLE HOTEL G	286,225	7,198,558.750
PS BUSINESS PARK P	266,625	6,721,616.250
BIOMED REALTY 7.375 A	301,348	7,578,902.200
WEINGARTEN RLTY F	491,596	12,343,975.560
LEXINGTON REALTY D	182,943	4,571,745.570
HOSPITALITY PROP C	849,762	21,320,528.580
PUBLIC STORAGE 6.875 O	515,000	14,471,500.000
EQUITY LIFESTYLE 8.034 A	313,000	8,050,360.000
PS BUSINESS PARK 6.875R	245,000	6,448,400.000
DUPONT FABROS 7.625 B	350,000	8,991,500.000
COMMONWEALTH REIT 7.25 E	500,000	12,845,000.000
COMMONWEALTH REIT 6.5% D	888,900	18,791,346.000
PEBBLEBROOK HOTEL 7.875 A	260,000	6,617,000.000

アメリカ・ドル 小計

アメリカ・ドル

			1,888,846,073.440 (150,578,808,976)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	7,880,688	58,120,074.000
	SEGREO PLC	13,033,282	27,956,389.890
	HAMMERSON PLC	12,656,046	51,953,068.830
	BRITISH LAND CO PLC	10,526,258	52,020,767.030
	GREAT PORTLAND ESTATES PL	4,544,445	16,632,668.700
	DERWENT LONDON PLC	997,952	17,144,815.360
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 223,827,783.810 (28,802,159,221)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	WESTFIELD RETAIL TRUST	36,085,912	98,875,398.880
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	10,782,100	20,647,721.500
	COMMONWEALTH PROPERTY OFF	49,980,900	51,480,327.000
	DEXUS PROPERTY GROUP	79,683,244	74,902,249.360
	GPT GROUP	25,875,087	84,352,783.620
	MIRVAC GROUP	31,889,538	42,094,190.160
	STOCKLAND	11,850,080	38,275,758.400
	WESTFIELD GROUP	22,302,875	211,654,283.750
	GOODMAN GROUP	11,861,709	43,413,854.940
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 665,696,567.610 (53,415,492,586)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,978,909	54,083,582.970
	DUNDEE REAL ESTATE INVEST	510,725	19,136,865.750
	BOARDWALK REAL ESTATE INV	608,446	36,482,422.160
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTA	1,495,827	33,910,398.090
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 143,613,268.970 (11,431,616,210)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	37,507,800	48,760,140.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	12,000,000	24,000,000.000
	CAPITAMALL TRUST	50,030,392	88,803,945.800
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	22,343,122	43,792,519.120
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 205,356,604.920 (13,081,215,734)
ユーロ			ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT	1,095,387	8,795,957.610
	CORIO NV	897,196	30,024,664.140
	EUROCOMMERCIAL -CVA	595,721	15,447,045.530
	ICADE	113,200	6,893,880.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,113,884	149,817,398.000
	GECINA SA	237,697	16,334,537.840
	KLEPIERRE	563,100	13,317,315.000
	FONCIERE DES REGIONS	243,974	12,757,400.460
	MERCIALYS	272,259	4,079,801.110
ユーロ 小計			ユーロ 257,467,999.690 (26,562,973,528)

香港・ドル	LINK REIT	21,051,720	香港・ドル 672,602,454.000
	CHAMPION REIT	69,446,376	228,478,577.040
香港・ドル 小計			香港・ドル 901,081,031.040 (9,254,102,189)
投資証券 合計			293,126,368,444 [293,126,368,444]
合計			293,126,368,444 [293,126,368,444]

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 70銘柄	100%	51.3%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	100%	9.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 9銘柄	100%	18.2%
カナダ・ドル	投資証券 4銘柄	100%	3.9%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	4.5%
ユーロ	投資証券 9銘柄	100%	9.1%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.2%

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

「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23年11月10日現在	平成24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	82,337,787	118,091,070
投資証券	10,257,064,500	10,837,906,970
未収入金	-	53,262,524
未収配当金	148,850,528	149,131,660
流動資産合計	10,488,252,815	11,158,392,224
資産合計	10,488,252,815	11,158,392,224
負債の部		
流動負債		
未払金	-	43,477,790
未払解約金	300,000	37,500,000
流動負債合計	300,000	80,977,790
負債合計	300,000	80,977,790
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,212,187,830	11,290,463,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,724,235,015	213,048,749
元本等合計	10,487,952,815	11,077,414,434
純資産合計	10,487,952,815	11,077,414,434
負債純資産合計	10,488,252,815	11,158,392,224

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23年11月11日 至 平成24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。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	13,642,301,744円	12,212,187,830円
同期中における追加設定元本額	348,624,192円	328,554,298円
同期中における一部解約元本額	1,778,738,106円	1,250,278,945円

同期末における元本の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	151,635,751円	126,777,049円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	162,926,610円	130,566,437円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	535,157,768円	462,957,735円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	2,881,075円	2,301,106円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	4,355,421円	3,823,784円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	12,104,822円	10,411,376円
6資産バランスファンド（分配型）	1,020,129,733円	835,901,818円
6資産バランスファンド（成長型）	1,402,091,167円	1,258,286,966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）	96,389,704円	82,749,679円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	596,617,739円	413,370,810円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	14,768,389円	11,711,329円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	446,041,038円	374,401,449円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	1,167,313円	- 円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	56,968円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）	145,933,643円	152,477,909円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ6分散コース）	155,099,043円	167,581,125円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ成長コース）	138,243,395円	149,847,278円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	96,735,784円	110,964,049円
ダイワファンドラップ J-REITセレクト	5,968,135,708円	5,886,554,778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）	325,568,283円	277,670,750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）	127,899,182円	109,877,337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）	617,246,523円	493,416,799円
ダイワJリート・ファンド	191,002,771円	228,813,620円
計	12,212,187,830円	11,290,463,183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	12,212,187,830口	11,290,463,183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1,724,235,015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213,048,749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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成23年11月10日現在	平成24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	2,241,715,928	1,004,035,085
合計	2,241,715,928	1,004,035,085

（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23年5月11日から平成23年11月10日まで、及び平成23年11月11日から平成24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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成23年11月10日現在	平成24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)	0.8588円 (8,588円)	0.9811円 (9,811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	650	334,750,000	
	M I Dリート投資法人	472	99,120,000	
	森ヒルズリート	1,350	426,600,000	
	野村不レジデンシャル	300	125,400,000	
	産業ファンド	449	213,275,000	
	アドバンス・レジデンス	3,800	584,440,000	
	日本ビルファンド	2,000	1,488,000,000	
	ジャパンリアルエステイト	1,850	1,313,500,000	
	日本リテールファンド	5,300	671,510,000	
	オリックス不動産投資	400	139,400,000	
	日本プライムリアルティ	1,950	447,135,000	
	プレミア投資法人	500	146,350,000	
	東急リアル・エステート	100	40,100,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	240	126,720,000	
	野村不動産オフィスF	800	359,200,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,500	512,050,000	
	森トラスト総合リート	600	404,400,000	
	フロンティア不動産投資	700	461,300,000	
	平和不動産リート	4,500	206,100,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	550	387,750,000	
	福岡リート投資法人	350	200,550,000	
	ケネディクス不動産投資法人	850	225,675,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	200	62,100,000	
	いちご不動産投資法人	5,200	176,800,000	
	大和証券オフィス投資法人	1,200	243,960,000	
	トップリート投資法人	500	217,500,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	716	385,924,000		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	19,121	374,197,970		
日本賃貸住宅投資法人	5,000	175,000,000		
ジャパンエクセレント投資法人	700	289,100,000		
投資証券 合計			10,837,906,970	
合計			10,837,906,970	

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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	31,711,399	26,794,037
コール・ローン	55,998,423	41,395,473
株式	1,640,976,331	1,557,614,040
ハイブリッド優先証券	526,863,818	492,300,485
投資証券	48,930,424	48,669,156
未収入金	22,782,403	11,216,892
未収配当金	2,433,195	1,924,661
未収利息	1,432,425	459,092
流動資産合計	2,331,128,418	2,180,373,836
資産合計	2,331,128,418	2,180,373,836
負債の部		
流動負債		
未払金	2,038,328	-
未払解約金	28,150,000	12,650,000
流動負債合計	30,188,328	12,650,000
負債合計	30,188,328	12,650,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,779,842,708	2,344,771,828
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 478,902,618	177,047,992
元本等合計	2,300,940,090	2,167,723,836
純資産合計	2,300,940,090	2,167,723,836
負債純資産合計	2,331,128,418	2,180,373,836

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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) ハイブリッド優先証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(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。 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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息 ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	3,141,443,545円	2,779,842,708円
同期中における追加設定元本額	59,368,536円	19,288,013円
同期中における一部解約元本額	420,969,373円	454,358,893円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株ファンド(毎月分配型)	265,286,091円	220,632,128円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	109,071,677円	88,342,535円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	115,461,651円	90,224,197円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,375,030,580円	1,149,330,995円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	2,085,412円	1,574,776円

インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	3,249,402円	2,562,796円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	31,452,181円	25,924,765円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	270,692,961円	206,357,744円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	319,117,767円	257,714,737円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	65,460,205円	67,697,667円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	105,451,343円	110,895,637円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	117,483,438円	123,513,851円
計	2,779,842,708円	2,344,771,828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	2,779,842,708口	2,344,771,828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478,902,618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177,047,992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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、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。
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得ます。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24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。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成23年11月10日現在	平成24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	7,499,329	30,943,022
ハイブリッド優先証券	6,334,479	2,168,976
投資証券	132,658	507,771
合計	13,966,466	28,266,275

(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23年10月18日から平成23年11月10日まで、及び平成24年4月17日から平成24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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年11月10日現在	平成24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)	0.8277円 (8,277円)	0.9245円 (9,245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	5,200	61.230	318,396.000	
	AFLAC INC	2,300	42.770	98,371.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	3,900	64.030	249,717.000	
	CITIGROUP INC	6,500	30.450	197,925.000	
	COVIDIEN PLC	6,700	54.230	363,341.000	
	APPLE INC	400	569.180	227,672.000	
	BECTON DICKINSON & CO	2,800	76.020	212,856.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON	5,000	22.190	110,950.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	13,400	40.640	544,576.000	
	CISCO SYSTEMS	7,800	18.780	146,484.000	
	DOW CHEMICAL	4,500	32.130	144,585.000	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	3,100	31.070	96,317.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	3,500	82.620	289,170.000	
	EXXON MOBIL CORP	7,000	83.310	583,170.000	

L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	3,800	70.460	267,748.000
NEXTERA ENERGY INC	3,500	64.150	224,525.000
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	2,800	35.530	99,484.000
US BANCORP	9,100	31.470	286,377.000
GENERAL ELECTRIC CO	14,700	18.910	277,977.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,200	107.290	128,748.000
HARRIS CORP	3,600	41.400	149,040.000
INT'L BUSINESS MACHINES	2,000	201.230	402,460.000
JOHNSON & JOHNSON	3,200	64.280	205,696.000
MCDONALD'S CORP	5,300	91.930	487,229.000
MERCK & CO INC	8,200	38.090	312,338.000
NIKE INC -CL B	1,000	108.150	108,150.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,300	68.390	157,297.000
NEWMONT MINIG CORP	3,900	46.540	181,506.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	5,300	85.640	453,892.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	3,900	84.280	328,692.000
PATTERSON COS INC	1,500	33.690	50,535.000
PG & E CORPORATION	2,600	44.110	114,686.000
PFIZER INC	12,300	22.450	276,135.000
PROCTER & GAMBLE CO	4,500	63.670	286,515.000
PEPSICO INC	4,200	65.940	276,948.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,900	51.060	250,194.000
ACCENTURE LTD-CL A	3,400	59.220	201,348.000
QUALCOMM INC	8,800	62.010	545,688.000
ROSS STORES INC	3,300	61.170	201,861.000
CHEVRON CORP	5,700	101.780	580,146.000
SYMANTEC CORP	5,800	15.820	91,756.000
SCHLUMBERGER LTD	2,900	69.640	201,956.000
AT&T INC	11,500	32.810	377,315.000
SEMPRA ENERGY	1,800	64.190	115,542.000
TIFFANY & CO	1,500	64.140	96,210.000
TIME WARNER CABLE	3,200	77.050	246,560.000
MARATHON PETROLEUM CORP	4,900	38.210	187,229.000
UNITED TECHNOLOGIES	3,300	77.010	254,133.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	5,100	77.150	393,465.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	7,900	55.220	436,238.000
THE WALT DISNEY CO.	9,500	45.020	427,690.000
WELLS FARGO & CO	10,100	32.630	329,563.000
WAL-MART STORES	1,900	59.030	112,157.000
WISCONSIN ENERGY CORP	6,600	36.700	242,220.000
VISA INC-CLASS A SHS	3,400	117.420	399,228.000
ORACLE CORPORATION	15,900	27.780	441,702.000
NORDSTROM INC	2,900	53.920	156,368.000
AMERICAN EXPRESS CO	4,500	59.460	267,570.000
EMERSON ELECTRIC CO	6,400	48.160	308,224.000
AMGEN	1,600	69.620	111,392.000
EATON CORP	4,100	45.070	184,787.000
CHUBB CORP	2,300	72.890	167,647.000
INTEL CORP	5,800	27.190	157,702.000
COMERICA INC	3,500	31.370	109,795.000
JOHNSON CONTROLS INC	7,700	31.610	243,397.000
MICROSOFT CORP	15,100	30.760	464,476.000
CVS CAREMARK CORP	9,200	45.230	416,116.000
BLACKROCK INC-CLASS A	1,000	180.270	180,270.000
APACHE CORP	2,900	87.170	252,793.000
PETSMART INC	1,900	56.590	107,521.000
CARNIVAL CORP	1,500	31.340	47,010.000

アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 17,966,777.000 (1,432,311,462)
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
	SUNCOR ENERGY INC	8,100	29.070	235,467.000
	TORONTO-DOMINION BANK	1,700	79.610	135,337.000
	ROYAL BANK OF CANADA	2,300	53.370	122,751.000
	TRANSCANADA CORP	2,300	42.810	98,463.000
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	3,700	41.620	153,994.000
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	7,200	35.680	256,896.000
	POWER CORP OF CANADA	9,000	24.410	219,690.000
FINNING INTERNATIONAL INC	4,100	25.830	105,903.000	
TIM HORTONS INC	4,400	55.830	245,652.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 1,574,153.000 (125,302,578)
合計				1,557,614,040 [1,557,614,040]

(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	
		AIG 6.45 A-4	2,000.000	47,880.000	
		COMCAST 6.625	5,218.000	131,545.780	
		JPMCHASE CAP XXIV 6.875	2,500.000	63,925.000	
		FIRST NIAGARA FIN VAR	7,862.000	218,878.080	
		DTE ENERGY COMPANY 6.5	9,000.000	248,940.000	
		DOMINION RES A 8.375	1,800.000	52,434.000	
		TELEPHONE & DATA 6.875	5,375.000	143,835.000	
		SEASPAN CORPORATION 9.5	6,874.000	185,185.560	
		ALLY FINANCIAL 7.3	5,145.000	120,804.600	
		FIFTH THIRD CAP VI	14,028.000	359,677.920	
		ZIONS BK C 9.5	3,906.000	102,532.500	
		MONTPELIER RE 8.875	4,000.000	107,800.000	
		AXIS CAPITAL HLDG 6.875	7,000.000	183,750.000	
		NEXTERA ENERGY CAP 5.7	3,000.000	78,180.000	
		FIRST REPUBLIC BANK 6.7	7,000.000	184,100.000	
		SCANA CORP A 7.7	2,100.000	58,968.000	
		ASPEN INSURANCE 7.25	2,300.000	57,569.000	
		JPMCHASE CAP XVI 6.350	6,400.000	163,584.000	
		COUNTRYWIDE CAP IV 6.75	4,916.000	116,263.400	
		MORGAN S CP TR III 6.25	3,000.000	71,790.000	
		METLIFE B 6.500	2,900.000	73,921.000	
		BGE CAPITAL TR II 6.200	3,788.000	96,063.680	
		FLEET CAP TR VIII 7.200	6,938.000	173,519.380	
		FPC CAPITAL I 7.100	1,577.000	40,796.990	
		PINCIPAL FINL GRP 6.518	2,000.000	52,040.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP 6.5	2,500.000	65,100.000	
		CITIGROUP CAP VIII 6.95	10,033.000	250,724.670	
		CITIGROUP CAP XV 6.50	5,500.000	136,620.000	
		JPMCHASE CAP XIX 6.625	3,600.000	91,800.000	
		MORGAN S CP TR VII 6.60	7,000.000	167,090.000	
		COUNTRYWIDE CAP V 7.00%	3,928.000	92,975.760	
ASPEN INSURANCE HLDG A	1,970.000	49,841.000			
CITIGROUP CAP XVI 6.45	6,121.000	150,699.020			
WELLS F CAP J 8.0	5,100.000	151,878.000			

		AIG 7.70 A-5	7,000.000	178,430.000	
		AMER FINL GROUP 7.0	4,361.000	114,127.370	
		US BANCORP VAR	10,000.000	272,200.000	
		RAYMOND JAMES 6.9	12,000.000	310,200.000	
		ARCH CAPITAL GRP C 6.75	8,600.000	223,600.000	
		PNC FINANCIAL VAR	9,000.000	226,620.000	
		QWEST CORPORATION 7.375	794.000	20,731.340	
		QWEST CORPORATION 7.5	2,720.000	71,508.800	
		QWEST CORPORATION 7.0	8,000.000	204,480.000	
		HARTFORD FINL SVCS VAR	6,000.000	157,080.000	
		ENDURANCE SPECIALTY 7.5	4,000.000	105,680.000	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 6,175,369.850 (492,300,485)	
ハイブリッド優先証券 合計				492,300,485 [492,300,485]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		COUSINS PROPERTY 7.75% A	4,470	111,884.100	
		DDR CORP 7.5 I	3,672	92,277.360	
		APARTMENT INVEST 8% V	3,401	86,691.490	
		CBL&ASSOC PROP 7.375% D	3,046	76,911.500	
		CORP OFFICE PROPS J	2,100	52,899.000	
		LEXINGTON REALTY D	3,500	87,465.000	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,945	102,372.750	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 610,501.200 (48,669,156)	
投資証券 合計				48,669,156 [48,669,156]	
合計				540,969,641 [540,969,641]	

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 71銘柄 ハイブリッド 45銘柄 優先証券 投資証券 7銘柄	72.6%	24.9%	2.5%	94.0%
カナダ・ドル	株式 9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
該当事項はありません。

[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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	-	29,771,367
コール・ローン	29,761,535	30,544,140
株式	2,007,357,861	1,897,835,544
未収入金	21,099,906	-
未収配当金	3,239,617	12,384,075
流動資産合計	2,061,458,919	1,970,535,126
資産合計	2,061,458,919	1,970,535,126
負債の部		
流動負債		
前受金	1,887,170	-
未払解約金	7,000,000	-
流動負債合計	8,887,170	-
負債合計	8,887,170	-
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,914,742,570
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	862,170,821
元本等合計		2,052,571,749
純資産合計		2,052,571,749
負債純資産合計		2,061,458,919

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23年11月11日 至 平成24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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	3,120,471,568円	2,914,742,570円
同期中における追加設定元本額	66,985,886円	60,770,215円
同期中における一部解約元本額	272,714,884円	345,671,774円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株ファンド(毎月分配型)	297,002,309円	263,749,148円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	115,427,756円	104,720,999円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	126,552,456円	107,803,701円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,570,928,605円	1,394,423,087円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	2,452,469円	1,903,303円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	4,096,097円	3,059,627円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	35,819,754円	31,558,777円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	224,113,304円	247,182,307円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	360,276,779円	303,044,094円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	41,651,885円	38,728,967円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	68,164,301円	62,337,056円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	68,256,855円	71,329,945円
計	2,914,742,570円	2,629,841,011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	2,914,742,570口	2,629,841,011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862,170,821円でありませ	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659,305,885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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産の売買代金、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。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年11月10日現在	平成24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	45,142,671	45,941,273
合計	45,142,671	45,941,273

(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23年10月18日から平成23年11月10日まで、及び平成24年4月17日から平成24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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年11月10日現在	平成24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)	0.7042円 (7,042円)	0.7493円 (7,493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	78,630	4.040	317,665.200	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	20,440	8.450	172,718.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C EN	2,139,080	0.001	2,139.080	
	REXAM PLC	81,604	4.028	328,700.910	
	PRUDENTIAL PLC	46,985	7.100	333,593.500	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	39,956	14.100	563,379.600	
	RIO TINTO PLC-REG	5,999	31.270	187,588.730	
	PEARSON PLC	20,817	11.630	242,101.710	
	VODAFONE GROUP PLC	354,250	1.710	605,767.500	
	KINGFISHER PLC	120,287	2.854	343,299.090	
	RECKITT BENCKISER PLC	9,215	35.660	328,606.900	
	NATIONAL GRID PLC	62,605	6.725	421,018.620	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	17,481	31.190	545,232.390	
HSBC HOLDINGS PLC	134,111	5.512	739,219.830		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	35,867	20.470	734,197.490		
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 5,865,228.550 (754,737,610)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	NESTLE SA-REGISTERED	20,643	54.900	1,133,300.700	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,659	217.800	579,130.200	
	NOVARTIS AG-REG SHS	13,957	49.420	689,754.940	
	GIVAUDAN REG	401	880.000	352,880.000	
HOLCIM LTD-REG	6,281	54.200	340,430.200		
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 3,095,496.040 (265,995,974)	
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	
	HENNES & MAURITZ AB-B	18,627	223.300	4,159,409.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	36,853	105.000	3,869,565.000	
	SKANSKA AB-B	19,020	109.300	2,078,886.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	23,657	132.200	3,127,455.400		
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 13,235,315.500 (153,397,307)	

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 ASA	41,558	58.200	2,418,675.600
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 2,418,675.600 (33,063,296)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ
	BAYER AG	8,047	52.560	422,950.320
	SIEMENS AG	5,313	66.900	355,439.700
	E.ON AG	6,138	15.420	94,647.960
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	3,884	67.700	262,946.800
	BASF SE	8,102	57.570	466,432.140
	ALLIANZ SE-REG	6,076	83.690	508,500.440
	PHILIPS ELECTRONICS NV	24,479	14.325	350,661.670
	AHOLD (KONINKLIJKE) NV	37,584	9.727	365,579.560
	AKZO NOBEL	9,211	38.370	353,426.070
	KONINKLIJKE KPN NV	43,194	7.725	333,673.650
	TOTAL SA	13,313	34.485	459,098.800
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	7,851	44.490	349,290.990
	BNP PARIBAS	13,818	28.375	392,085.750
	FRANCE TELECOM SA	15,464	10.425	161,212.200
	SANOFI	9,922	58.100	576,468.200
	GDF SUEZ	22,790	16.850	384,011.500
	BELGACOM SA	4,622	22.205	102,631.510
	REPSOL YPF SA	13,716	13.130	180,091.080
	BANCO SANTANDER SA	51,789	4.642	240,404.530
	OESTERREICHISCHE POST	12,936	25.870	334,654.320
ユーロ 小計				ユーロ 6,694,207.190 (690,641,357)
合計				1,897,835,544 [1,897,835,544]

- (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 15銘柄	100%	39.8%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	14.0%
スウェーデン・クローナ	株式 4銘柄	100%	8.1%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.7%
ユーロ	株式 20銘柄	100%	36.4%

- 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
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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	37,876,743	68,596,133
コール・ローン	15,218,510	26,929,088
株式	2,026,121,737	1,773,868,281
投資証券	-	30,908,448
未収入金	-	59,922,184
未収配当金	886,613	3,156,623
流動資産合計	2,080,103,603	1,963,380,757
資産合計	2,080,103,603	1,963,380,757
負債の部		
流動負債		
未払金	-	14,292,059
未払解約金	8,800,000	10,000,000
流動負債合計	8,800,000	24,292,059
負債合計	8,800,000	24,292,059
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,865,258,422
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206,045,181	257,229,146
元本等合計	2,071,303,603	1,939,088,698
純資産合計	2,071,303,603	1,939,088,698
負債純資産合計	2,080,103,603	1,963,380,757

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23年11月11日 至 平成24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) 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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	1,998,126,961円	1,865,258,422円
同期中における追加設定元本額	12,841,989円	7,232,733円
同期中における一部解約元本額	145,710,528円	190,631,603円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル好配当株ファンド(毎月分配型)	199,173,417円	175,604,517円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	77,503,512円	74,086,415円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	86,109,940円	75,498,539円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	1,041,646,710円	935,252,108円
安定重視ポートフォリオ(資産形成型)	1,611,301円	1,376,265円
インカム重視ポートフォリオ(資産形成型)	2,709,100円	2,063,205円
成長重視ポートフォリオ(資産形成型)	23,898,009円	20,905,923円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	174,652,508円	167,745,031円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	235,894,281円	205,050,704円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	4,615,058円	5,455,607円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	9,131,329円	9,131,329円

DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	8,313,257円	9,689,909円
計	1,865,258,422円	1,681,859,552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	1,865,258,422口	1,681,859,552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23年11月11日 至平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金、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。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成23年11月10日現在	平成24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	76,860,929	47,484,378
投資証券	-	1,091,264
合計	76,860,929	46,393,114

(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23年10月18日から平成23年11月10日まで、及び平成24年4月17日から平成24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23年11月10日現在	平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成23年11月10日現在	平成24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)	1.1529円 (11,529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	40,000	34.330	1,373,200.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	8,000	33.050	264,400.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	10,000	24.610	246,100.000	
	WESTPAC BANKING	10,000	22.840	228,400.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	45,000	23.120	1,040,400.000	
	RIO TINTO LTD	6,000	61.230	367,380.000	
	NEWCREST MINING	4,500	23.800	107,100.000	
	ADELAIDE BRIGHTON LIMITED	47,000	2.980	140,060.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	21,000	51.660	1,084,860.000	
	ORICA LIMITED	18,500	26.500	490,250.000	
	QBE INSURANCE	14,000	13.170	184,380.000	
	SEVEN WEST MEDIA LTD	30,000	2.780	83,400.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	25,000	12.530	313,250.000	
	TELSTRA CORPORATION	75,000	3.650	273,750.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	5,000	27.450	137,250.000	
	CSL LIMITED	8,000	37.190	297,520.000	
	ONESTEEL LIMITED	40,000	1.100	44,000.000	
	WESFARMERS LIMITED	23,000	30.150	693,450.000	
KINGSGATE CONSOLIDATED NL	10,000	5.530	55,300.000		
SUNCORP GROUP LTD	44,000	8.220	361,680.000		
ILUKA RESOURCES LTD	8,000	12.850	102,800.000		
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 7,888,930.000 (633,007,744)	
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	35,000	18.200	637,000.000	
	KEPPEL CORP	27,500	10.500	288,750.000	
	CAPITALAND LIMITED	30,000	2.700	81,000.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	4,000	45.500	182,000.000	
O.C.B.C.	30,000	8.820	264,600.000		

	SINGAPORE TELECOM	100,000	3.160	316,000.000
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	225,000	0.675	151,875.000
	M1 LTD	114,000	2.490	283,860.000
	OLAM INTERNATIONAL LTD	37,000	2.160	79,920.000
	INDOFOOD AGRI RESOURCES L	75,000	1.410	105,750.000
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 2,390,755.000 (152,291,094)
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン
	HYUNDAI ENGINEERING & CON	2,000	67,000.000	134,000,000.000
	SAMSUNG C&T CORP	3,500	72,400.000	253,400,000.000
	CHEIL INDUSTRIES INC	1,000	101,000.000	101,000,000.000
	HYUNDAI MOTOR CO	3,800	250,000.000	950,000,000.000
	POSCO	1,000	385,000.000	385,000,000.000
	WOORI INVESTMENT & SEC	7,000	11,450.000	80,150,000.000
	GS ENGINEERING&CONSTRUCT	1,000	78,800.000	78,800,000.000
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	900	260,500.000	234,450,000.000
	S-OIL CORPORATION	1,000	97,200.000	97,200,000.000
	S1 CORPORATION	2,000	58,000.000	116,000,000.000
	HALLA CLIMATE CONTROL	5,000	21,500.000	107,500,000.000
	SAMSUNG ENGINEERING CO LT	1,500	188,000.000	282,000,000.000
	KT&G CORP	1,200	78,500.000	94,200,000.000
	LG HOUSEHOLD & HEALTH	650	606,000.000	393,900,000.000
	LG CHEMICAL LTD	1,400	286,500.000	401,100,000.000
	SAMSUNG ELECTRONICS	1,680	1,331,000.000	2,236,080,000.000
	SK TELECOM CO LTD	1,100	138,500.000	152,350,000.000
	KOREA EXCHANGE BANK	15,000	8,390.000	125,850,000.000
	HANA FINANCIAL GROUP	10,500	39,650.000	416,325,000.000
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 6,639,305,000.000 (464,087,420)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO	80,000	5.500	440,000.000
	CHEUNG KONG	15,000	99.350	1,490,250.000
	WHARF HOLDINGS	25,000	43.750	1,093,750.000
	CLP HOLDINGS LIMITED	20,000	65.900	1,318,000.000
	HUTCHISON WHAMPOA	40,000	72.450	2,898,000.000
	HK & CHINA GAS	20,000	19.620	392,400.000
	HANG SENG BANK	17,000	106.500	1,810,500.000
	HONG KONG EX & CL	10,000	118.900	1,189,000.000
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	50,000	27.050	1,352,500.000
	GIORDANO INTERNATIONAL	250,000	6.880	1,720,000.000
	SJM HOLDINGS LTD	130,000	16.080	2,090,400.000
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	20,000	45.400	908,000.000
	AIA GROUP LTD	50,000	27.150	1,357,500.000
	IND & COMM BK OF CHINA-H	200,000	4.970	994,000.000
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS	130,000	23.750	3,087,500.000
	TCL COMMUNICATION TECH	170,000	3.170	538,900.000
香港・ドル 小計				香港・ドル 22,680,700.000 (232,930,789)
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル
	TAIWAN CEMENT	150,000	35.000	5,250,000.000
	FORMOSA PLASTICS CORP	60,000	79.400	4,764,000.000
	ORIENTAL UNION CHEMICAL	100,000	37.300	3,730,000.000
	CHINA STEEL CORP	134,395	28.500	3,830,257.500

ACER INC	120,000	33.300	3,996,000.000	
EPISTAR CORP	65,000	72.500	4,712,500.000	
HTC CORPORATION	5,000	452.500	2,262,500.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING	70,000	29.900	2,093,000.000	
CHINATRUST FINANCIAL HOLD	350,000	18.350	6,422,500.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS	30,000	91.100	2,733,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80,000	30.800	2,464,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	20,000	92.900	1,858,000.000	
TPK HOLDING CO LTD	4,000	371.000	1,484,000.000	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	30,000	183.500	5,505,000.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO L	220,000	64.500	14,190,000.000	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS	30,000	131.000	3,930,000.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	300,000	84.600	25,380,000.000	
HON HAI PRECISION INDUS	80,000	87.300	6,984,000.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY	189,108	31.700	5,994,723.600	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 107,583,481.100 (291,551,234)	
合計			1,773,868,281 [1,773,868,281]	

(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	オーストラリア・ドル	STOCKLAND	40,000	129,200.000	
		ARDENT LEISURE LTD	200,000	256,000.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 385,200.000 (30,908,448)	
投資証券 合計			30,908,448 [30,908,448]		
合計			30,908,448 [30,908,448]		

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 投資証券 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 21銘柄 投資証券 2銘柄	95.3%	4.7%	36.8%
シンガポール・ドル	株式 10銘柄	100%	-%	8.4%
韓国・ウォン	株式 19銘柄	100%	-%	25.7%
香港・ドル	株式 16銘柄	100%	-%	12.9%
台湾・ドル	株式 19銘柄	100%	-%	16.2%

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23年11月10日現在	平成24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	577,126,468	1,142,694,241
株式	21,716,583,100	22,489,644,000
未収入金	4,253,339	147,882,475
未収配当金	288,194,526	389,623,764
前払金	-	36,200,000
差入委託証拠金	-	13,200,000
流動資産合計	22,586,157,433	24,219,244,480
資産合計	22,586,157,433	24,219,244,480
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	36,718,642
未払金	110,596,564	349,410,488
未払解約金	8,000,000	17,500,000
流動負債合計	118,596,564	403,629,130
負債合計	118,596,564	403,629,130
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,819,383,735	21,835,261,116
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,351,822,866	1,980,354,234
元本等合計	22,467,560,869	23,815,615,350
純資産合計	22,467,560,869	23,815,615,350
負債純資産合計	22,586,157,433	24,219,244,480

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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
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、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年11月10日現在	平成24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	25,290,227,624円	23,819,383,735円
同期中における追加設定元本額	1,421,743,986円	1,340,168,620円
同期中における一部解約元本額	2,892,587,875円	3,324,291,239円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信Q（FOFs用）（適格機関投資家専用）	6,095,956,987円	6,426,010,496円
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	11,426,256,163円	10,183,818,532円
ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型）	34,357,188円	30,580,618円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	103,107,246円	90,457,052円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	285,477,382円	228,297,870円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	304,144,395円	236,170,121円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	3,558,958,955円	2,963,833,745円
安定重視ポートフォリオ（資産形成型）	5,452,309円	4,140,659円
インカム重視ポートフォリオ（資産形成型）	8,047,274円	6,752,624円
成長重視ポートフォリオ（資産形成型）	79,491,616円	66,687,995円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	717,392,372円	532,054,187円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	813,748,469円	660,932,786円
ダイワ円債重視バランスファンド（奇数月決算型）	1,079,321円	- 円
ダイワ円債重視バランスファンド（資産形成型）	53,204円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	88,234,677円	90,660,764円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	140,157,055円	148,680,948円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	157,469,122円	166,182,719円
計	23,819,383,735円	21,835,261,116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	23,819,383,735口	21,835,261,116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1,351,822,866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23年11月11日 至 平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所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。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成23年11月10日現在	平成24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	1,007,729,047	555,115,996
合計	1,007,729,047	555,115,996

(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23年10月18日から平成23年11月10日まで、及び平成24年4月17日から平成24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23年11月10日現在				平成24年5月10日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	-	-	-	-	397,800,000	-	361,200,000	36,600,000
合計	-	-	-	-	397,800,000	-	361,200,000	36,600,000

(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23年11月10日現在	平成24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)	0.9432円 (9,432円)	1.0907円 (10,907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	
ショーボンドHD	32,000	1,986	63,552,000	
西松建設	420,000	150	63,000,000	
前田建設	220,000	319	70,180,000	
田辺工業	104,900	477	50,037,300	
大東建託	26,800	7,210	193,228,000	
新日本建設	599,100	203	121,617,300	
太平電業	40,000	643	25,720,000	
ノバレーゼ	350	53,000	18,550,000	
S Foods	1,000	699	699,000	
NECフィールドディング	75,000	989	74,175,000	
東北新社	180,200	660	118,932,000	
KG情報	51,100	489	24,987,900	
コメ兵	147,000	553	81,291,000	
あいホールディングス	286,000	499	142,714,000	
サイボー	99,900	380	37,962,000	
UKCホールディングス	288,000	1,138	327,744,000	
クリヤマ	208,900	507	105,912,300	
クラレ	52,000	1,100	57,200,000	
日本バイリン	158,000	353	55,774,000	
セーレン	206,000	545	112,270,000	

ITホールディングス	168,000	1,014	170,352,000
リスクモンスター	40	43,200	1,728,000
ニフティ	980	112,900	110,642,000
トーモク	595,000	251	149,345,000
住友化学	400,000	302	120,800,000
日本曹達	210,000	318	66,780,000
日本ピグメント	419,000	220	92,180,000
三菱瓦斯化学	240,000	544	130,560,000
サンエー化研	112,100	304	34,078,400
セプテーニHLDGS	2,894	64,500	186,663,000
テイクアンドギヴニーズ	9,510	9,540	90,725,400
メディカルシステムネットワーク	206,000	1,336	275,216,000
ハリマ化成	418,000	542	226,556,000
ダイト	118,000	1,198	141,364,000
エスケー化研	2,000	3,250	6,500,000
秀英予備校	202,300	306	61,903,800
フューチャーアーキテクト	570	34,500	19,665,000
シーエーシー	283,000	677	191,591,000
トーセ	122,000	555	67,710,000
日本ハウズイング	55,100	2,050	112,955,000
電通国際情報S	92,600	597	55,282,200
ケミプロ化成	11,000	117	1,287,000
メック	286,000	293	83,798,000
荏原ユーザライト	30,500	2,276	69,418,000
ニチレキ	112,000	383	42,896,000
東燃ゼネラル石油	324,000	722	233,928,000
JXホールディングス	105,900	431	45,642,900
横浜ゴム	202,000	561	113,322,000
住友ゴム	250,000	1,023	255,750,000
西川ゴム工業	63,000	808	50,904,000
フコク	183,300	861	157,821,300
日本ヒューム	335,000	329	110,215,000
ニッカトー	102,400	479	49,049,600
クニミネ工業	50,000	485	24,250,000
東洋鋼鈹	560,000	273	152,880,000
モリ工業	630,000	253	159,390,000
川金ホールディングス	259,600	275	71,390,000
三菱製鋼	520,000	218	113,360,000
日本精線	178,000	382	67,996,000
古河スカイ	36,000	227	8,172,000
住友電工	166,000	1,026	170,316,000
タツタ電線	224,000	457	102,368,000
オーナンバ	239,200	481	115,055,200
川岸工業	259,000	206	53,354,000
那須電機	272,000	245	66,640,000
高田機工	498,000	204	101,592,000
アルインコ	63,400	560	35,504,000
ダイニチ工業	125,000	708	88,500,000
日東精工	130,000	241	31,330,000
岡部	360,000	521	187,560,000
ジーテクト	32,300	2,565	82,849,500
トーアミ	44,700	475	21,232,500
パイオラックス	140,500	1,914	268,917,000
アイダエンジニア	104,000	433	45,032,000
富士機械製造	92,800	1,554	144,211,200

エイチアンドエフ	111,700	491	54,844,700
やまびこ	40,000	1,214	48,560,000
藤商事	482	88,200	42,512,400
ホソカワミクロン	226,000	454	102,604,000
瑞光	11,500	1,895	21,792,500
オカダアイヨン	344,000	490	168,560,000
小松製作所	132,000	2,052	270,864,000
フロイント産業	191,100	726	138,738,600
シンニッタン	1,077,700	511	550,704,700
鶴見製作所	121,000	665	80,465,000
加藤製作所	1,126,000	372	418,872,000
理想科学工業	165,200	1,166	192,623,200
ダイコク電機	14,000	1,138	15,932,000
新晃工業	12,000	395	4,740,000
T P R	86,000	1,254	107,844,000
ニチダイ	61,300	507	31,079,100
放電精密加工研	45,600	518	23,620,800
大豊工業	159,700	1,003	160,179,100
前澤給装工業	8,000	1,062	8,496,000
日本ピラ - 工業	296,000	666	197,136,000
デンヨー	60,900	1,018	61,996,200
三桜工業	180,000	638	114,840,000
愛知電機	947,000	350	331,450,000
M C J	2,393,000	147	351,771,000
ナカヨ通信機	175,000	341	59,675,000
T O A	165,000	622	102,630,000
スミダコーポレーション	174,000	455	79,170,000
三社電機製作所	489,000	396	193,644,000
オーデリック	59,300	1,198	71,041,400
岡谷電機	149,000	316	47,084,000
日本デジタル研究所	399,100	846	337,638,600
芝浦電子	88,600	1,451	128,558,600
ユーシン	15,300	576	8,812,800
指月電機	33,000	355	11,715,000
日本輸送機	418,000	241	100,738,000
日産自動車	150,000	778	116,700,000
トヨタ自動車	70,000	3,170	221,900,000
G M B	173,500	1,378	239,083,000
ユタカ技研	400	1,770	708,000
自動車部品	562,000	527	296,174,000
東京ラヂエ - タ -	432,000	494	213,408,000
ティラド	330,000	298	98,340,000
太平洋工業	243,000	490	119,070,000
今仙電機製作所	92,000	1,095	100,740,000
本田技研	44,000	2,711	119,284,000
T B K	533,000	516	275,028,000
日本プラスト	162,000	612	99,144,000
村上開明堂	128,000	1,130	144,640,000
フジオーゼックス	180,000	359	64,620,000
良品計画	30,000	4,210	126,300,000
ヒマラヤ	43,800	590	25,842,000
ネットワンシステムズ	222,000	1,174	260,628,000
トーメンエレクトロニクス	136,000	1,173	159,528,000
ワークマン	6,900	2,720	18,768,000
マルカキカイ	82,000	896	73,472,000

アルゴグラフィックス	39,900	1,127	44,967,300
HOYA	94,000	1,806	169,764,000
キヤノン	170,000	3,460	588,200,000
ニホンフラッシュ	15,100	1,012	15,281,200
前田工織	25,300	1,987	50,271,100
萩原工業	96,000	1,335	128,160,000
藤森工業	141,000	1,365	192,465,000
ニッピ	31,000	665	20,615,000
イトーキ	246,000	489	120,294,000
丸紅	628,000	537	337,236,000
三井物産	48,000	1,134	54,432,000
住友商事	344,000	1,094	376,336,000
佐藤商事	9,400	581	5,461,400
三谷商事	24,000	1,044	25,056,000
フルサト工業	18,000	760	13,680,000
ワキタ	265,000	620	164,300,000
ヤマトインタ-ナショナル	48,300	383	18,498,900
東陽テクニカ	70,300	887	62,356,100
三菱UFJフィナンシャルG	1,700,000	357	606,900,000
三井住友フィナンシャルG	240,000	2,403	576,720,000
北越銀行	44,000	156	6,864,000
大分銀行	696,000	222	154,512,000
宮崎銀行	602,000	193	116,186,000
琉球銀行	104,000	1,036	107,744,000
みずほフィナンシャルG	1,200,000	118	141,600,000
芙蓉総合リース	42,000	2,457	103,194,000
東日本銀行	720,000	167	120,240,000
MS&AD	88,000	1,389	122,232,000
NECキャピタルソリューション	241,200	1,035	249,642,000
京阪神ビルディング	149,000	361	53,789,000
明和地所	300,000	392	117,600,000
日本エスリード	248,000	709	175,832,000
日神不動産	348,200	497	173,055,400
リベステ	3,307	56,000	185,192,000
サンヨーハウジ名古屋	2,060	76,400	157,384,000
サカイ引越センター	48,500	1,666	80,801,000
アルプス物流	246,900	794	196,038,600
ヒューテックノオリン	222,200	800	177,760,000
日本郵船	760,000	208	158,080,000
川崎近海汽船	251,000	218	54,718,000
三井倉庫	270,000	328	88,560,000
東陽倉庫	495,000	179	88,605,000
イヌイ倉庫	116,000	432	50,112,000
日本電信電話	70,000	3,555	248,850,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,800	130,000	234,000,000
エムティーアイ	630	117,000	73,710,000
北海道瓦斯	169,000	254	42,926,000
葵プロモーション	15,500	512	7,936,000
シーイーシー	12,000	414	4,968,000
西尾レントオール	114,000	1,036	118,104,000
東海リース	299,000	171	51,129,000
ステップ	137,000	540	73,980,000
日立機材	344,000	684	235,296,000
バイテック	87,500	621	54,337,500
やまや	69,000	1,381	95,289,000

合計				22,489,644,000
----	--	--	--	----------------

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「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、当特定期間（平成23年11月11日から平成24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23年11月10日現在	平成24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	26,580,490	24,530,740
親投資信託受益証券	2,963,704,422	2,617,029,973
未収入金	45,000,000	22,000,000
流動資産合計	3,035,284,912	2,663,560,713
資産合計	3,035,284,912	2,663,560,713
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	35,291,430	20,301,732
未払解約金	7,859,475	1,758,065
未払受託者報酬	259,786	235,112
未払委託者報酬	6,365,032	5,760,634
その他未払費用	133,994	110,180
流動負債合計	49,909,717	28,165,723
負債合計	49,909,717	28,165,723
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,705,524,068	4,060,346,480
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 1,720,148,873	1,424,951,490
(分配準備積立金)	87,960,372	62,071,823
元本等合計	2,985,375,195	2,635,394,990
純資産合計	2,985,375,195	2,635,394,990
負債純資産合計	3,035,284,912	2,663,560,713

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成23年5月11日 至平成23年11月10日	自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	13,242	10,771
有価証券売買等損益	156,733,521	169,325,551
営業収益合計	156,720,279	169,336,322
営業費用		
受託者報酬	893,904	735,115
委託者報酬	1	18,011,623
その他費用	133,994	110,180
営業費用合計	22,929,529	18,856,918
営業利益又は営業損失()	179,649,808	150,479,404
経常利益又は経常損失()	179,649,808	150,479,404
当期純利益又は当期純損失()	179,649,808	150,479,404
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()	7,510,269	5,644,420
期首剰余金又は期首欠損金()	1,682,400,416	1,720,148,873
剰余金増加額又は欠損金減少額	258,304,394	245,136,497
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	258,304,394	245,136,497
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,237,869	9,124,415
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	12,237,869	9,124,415
分配金	2	85,649,683
期末剰余金又は期末欠損金()	1,720,148,873	1,424,951,490

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期 自平成23年11月11日 至平成24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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
1. 1 期首元本額	5,466,711,983円	4,705,524,068円
期中追加設定元本額	38,330,975円	25,529,761円
期中一部解約元本額	799,518,890円	670,707,349円
2. 特定期間末日における受益権の総数	4,705,524,068口	4,060,346,480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1,720,148,873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1,424,951,490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23年5月11日 至平成23年11月10日	当期 自平成23年11月11日 至平成24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	786,485円	710,176円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成23年5月11日 至平成23年7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（22,161,168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（25,074,850円）及び分配準備積立金（155,305,748円）より分配対象額は202,541,766円（1万口当たり386.64円）であり、うち39,289,083円（1万口当たり75円）を分配金額としております。	（自平成23年11月11日 至平成24年1月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,071,655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（22,072,452円）及び分配準備積立金（84,001,848円）より分配対象額は119,145,955円（1万口当たり264.68円）であり、うち33,761,348円（1万口当たり75円）を分配金額としております。

	<p>(自平成23年7月12日 至平成23年9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(18,980,747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(23,886,743円)及び分配準備積立金(130,252,466円)より分配対象額は173,119,956円(1万口当たり350.02円)であり、うち37,094,930円(1万口当たり75円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成23年9月13日 至平成23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(16,753,444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(22,917,428円)及び分配準備積立金(106,498,358円)より分配対象額は146,169,230円(1万口当たり310.63円)であり、うち35,291,430円(1万口当たり75円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成24年1月11日 至平成24年3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(19,013,293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(20,784,865円)及び分配準備積立金(59,104,092円)より分配対象額は98,902,250円(1万口当たり234.84円)であり、うち31,586,603円(1万口当たり75円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成24年3月13日 至平成24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(17,728,133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(5,129,925円)及び分配準備積立金(59,773,007円)より分配対象額は82,631,065円(1万口当たり203.51円)であり、うち20,301,732円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>
--	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	当期 自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期 平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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	23,529,879	74,655,392
合計	23,529,879	74,655,392

(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23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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)	0.6344円 (6,344円)	0.6491円 (6,491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	1,577,290,475	1,851,423,559	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	137,117,832	128,685,085	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	130,566,437	128,098,731	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	90,224,197	83,412,270	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	107,803,701	80,777,313	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	75,498,539	87,042,265	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	236,170,121	257,590,750	
親投資信託受益証券 合計			2,617,029,973	
合計			2,617,029,973	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成23年11月11日から平成24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	当期
	平成23年11月10日現在	平成24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	90,568,046	85,203,175
親投資信託受益証券	9,681,967,168	9,187,208,197
未収入金	93,500,000	73,000,000
流動資産合計	9,866,035,214	9,345,411,372
資産合計	9,866,035,214	9,345,411,372
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	70,619,279	62,524,688
未払解約金	20,538,128	9,401,273
未払受託者報酬	848,792	837,972
未払委託者報酬	22,069,228	21,787,966
その他未払費用	443,674	378,673
流動負債合計	114,519,101	94,930,572
負債合計	114,519,101	94,930,572
純資産の部		
元本等		
元本	17,654,819,802	15,631,172,119
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 7,903,303,689	6,380,691,319
(分配準備積立金)	1,028,090,605	858,282,372
元本等合計	9,751,516,113	9,250,480,800
純資産合計	9,751,516,113	9,250,480,800
負債純資産合計	9,866,035,214	9,345,411,372

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成23年5月11日 至平成23年11月10日	自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	43,363	36,299
有価証券売買等損益	1,308,612,751	935,741,029
営業収益合計	1,308,569,388	935,777,328
営業費用		
受託者報酬	2,958,349	2,525,024
委託者報酬	1 76,918,939	65,652,127
その他費用	443,674	378,673
営業費用合計	80,320,962	68,555,824
営業利益又は営業損失()	1,388,890,350	867,221,504
経常利益又は経常損失()	1,388,890,350	867,221,504
当期純利益又は当期純損失()	1,388,890,350	867,221,504
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()	41,583,260	23,929,195
期首剰余金又は期首欠損金()	7,353,381,444	7,903,303,689
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,042,289,645	897,985,180
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,042,289,645	897,985,180
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,700,268	23,508,119
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	23,700,268	23,508,119
分配金	2 221,204,532	195,157,000
期末剰余金又は期末欠損金()	7,903,303,689	6,380,691,319

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当期 自平成23年11月11日 至平成24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。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
1. 1 期首元本額	20,298,811,420円	17,654,819,802円
期中追加設定元本額	60,003,410円	55,178,530円
期中一部解約元本額	2,703,995,028円	2,078,826,213円
2. 特定期間末日における受益権の総数	17,654,819,802口	15,631,172,119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7,903,303,689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6,380,691,319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23年5月11日 至平成23年11月10日	当期 自平成23年11月11日 至平成24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	7,397,806円	6,461,175円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成23年5月11日 至平成23年7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（40,299,972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（801,716,904円）及び分配準備積立金（1,224,825,251円）より分配対象額は2,066,842,127円（1万口当たり1,074.69円）であり、うち76,927,651円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自平成23年11月11日 至平成24年1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（19,509,274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（712,383,300円）及び分配準備積立金（989,445,925円）より分配対象額は1,721,338,499円（1万口当たり1,011.96円）であり、うち68,039,761円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

	<p>(自平成23年7月12日 至平成23年9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(28,747,104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(768,810,140円)及び分配準備積立金(1,136,521,547円)より分配対象額は1,934,078,791円(1万口当たり1,050.31円)であり、うち73,657,602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9月13日 至平成23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(53,269,909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(738,249,919円)及び分配準備積立金(1,045,439,975円)より分配対象額は1,836,959,803円(1万口当たり1,040.49円)であり、うち70,619,279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24年1月11日 至平成24年3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(43,617,492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(677,343,721円)及び分配準備積立金(892,196,048円)より分配対象額は1,613,157,261円(1万口当たり998.97円)であり、うち64,592,551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24年3月13日 至平成24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(78,316,185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(656,509,594円)及び分配準備積立金(842,490,875円)より分配対象額は1,577,316,654円(1万口当たり1,009.08円)であり、うち62,524,688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	当期 自平成23年11月11日 至平成24年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	当期 平成24年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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	43,973,263	381,199,409
合計	43,973,263	381,199,409

(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23年11月10日現在	当期 平成24年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当期 自 平成23年11月11日 至 平成24年5月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 平成23年11月10日現在	当期 平成24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)	0.5523円 (5,523円)	0.5918円 (5,918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	1,585,912,227	1,861,543,772	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	482,848,428	453,153,249	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	462,957,735	454,207,833	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,149,330,995	1,062,556,504	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	1,394,423,087	1,044,841,219	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	935,252,108	1,078,252,155	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	2,963,833,745	3,232,653,465	
親投資信託受益証券 合計			9,187,208,197	
合計			9,187,208,197	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

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 2 ファンドの現況」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）

【純資産額計算書】

平成24年5月31日

資産総額	2,477,054,951円
負債総額	2,165,628円
純資産総額（ - ）	2,474,889,323円
発行済数量	3,345,725,973口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7397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24年5月31日

資産総額	80,665,331,125円
負債総額	524,588,208円
純資産総額（ - ）	80,140,742,917円
発行済数量	69,785,730,954口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1484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24年5月31日

資産総額	258,734,425,066円
負債総額	384,384,517円
純資産総額（ - ）	258,350,040,549円
発行済数量	225,065,997,461口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1479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24年5月31日

資産総額	274,947,910,643円
負債総額	841,300,000円

純資産総額(-)	274,106,610,643円
発行済数量	309,513,891,406口
1単位当たり純資産額(/)	0.8856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24年5月31日

資産総額	10,830,707,102円
負債総額	4,170,000円
純資産総額(-)	10,826,537,102円
発行済数量	11,227,254,133口
1単位当たり純資産額(/)	0.9643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24年5月31日

資産総額	2,081,201,842円
負債総額	13,788,571円
純資産総額(-)	2,067,413,271円
発行済数量	2,313,507,437口
1単位当たり純資産額(/)	0.8936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24年5月31日

資産総額	1,825,754,125円
負債総額	2,743,058円
純資産総額(-)	1,823,011,067円
発行済数量	2,632,995,086口
1単位当たり純資産額(/)	0.6924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24年5月31日

資産総額	1,793,850,524円
負債総額	0円
純資産総額(-)	1,793,850,524円

発行済数量	1,680,390,845口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0675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24年5月31日

資産総額	22,282,735,476円
負債総額	371,694,121円
純資産総額 (-)	21,911,041,355円
発行済数量	21,833,206,742口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0036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24年5月31日

資産総額	2,413,849,071円
負債総額	6,916,491円
純資産総額 (-)	2,406,932,580円
発行済数量	3,835,808,049口
1 単位当たり純資産額 (/)	0.6275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24年5月31日

資産総額	8,616,200,066円
負債総額	14,475,758円
純資産総額（ - ）	8,601,724,308円
発行済数量	15,425,427,512口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5576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24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C I O（Chief Investment Officer）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

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．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24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	4	11,367
追加型株式投資信託	406	6,641,716
株式投資信託 合計	410	6,653,083
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,406,846
公社債投資信託 合計	17	2,406,846
総合計	427	9,059,929

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。
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、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、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23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1,003,450
建物（純額）	332,407	513,162
器具備品（純額）	634,782	484,571
建設仮勘定	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132
その他	596	471
投資その他の資産	18,825,476	16,375,520

投資有価証券		12,339,547		10,034,136
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		142,215		136,315
従業員に対する長期貸付金		99,889		112,674
差入保証金		609,781		542,920
長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産（純額）	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2,627,872	3,702,277
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
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		
繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414

株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663
純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

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。

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。

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。

（3）長期前払費用

定額法によっております。

4．引当金の計上基準

（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。

（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、能力及び実績等に依り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。

（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。

（５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（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

（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。

（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。

６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（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。

（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。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

ため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

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。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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つのグループ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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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つのグループピ
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
（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円で
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）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
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

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27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24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 7,022百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 2,692円
 基準日 平成24年3月31日
 効力発生日 平成24年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。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、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。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価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）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

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（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。

当事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
(2) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
(1) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
(2) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
(3) 未払費用(*1)	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引(*2)	(87,535)	(87,535)	-

(*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	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	609,781	542,920

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（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	-

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（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	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
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	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

	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 (2) その他 証券投資信託の受益証券	54,283 25,277,982	55,101 25,890,888	818 612,906
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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

	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	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの (1) 株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）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. 売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(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	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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
				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
合計			2,435,030	-	183,430

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、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。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度（平成23年3月31日 現在）	当事業年度（平成24年3月31日 現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：%）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
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	-

（注）当事業年度は、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。

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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	76,217	76,217

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (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 (注)	1,372,770	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関する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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (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㈱	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㈱	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。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(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	19,792,278	未払手数料	2,376,978
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	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

(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) 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。

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

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)

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
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	1株当たり純資産額 13,358.92円 1株当たり当期純利益 2,692.30円

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

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(追加情報)

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

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

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1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24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	21,784	（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	2,679	
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	25,841	（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)	() 1,410,741
---	---------------

() 資本金の額は、平成24年5月2日現在のものです。

(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&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 462千米ドル(約35百万円)(平成23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104百万円)(平成23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24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24年6月8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23年11月11日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

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24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。

利害関係

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24年6月8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23年11月11日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

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24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。

利害関係

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24年6月8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23年11月11日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

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24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。

利害関係

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）](#)△

独立監査人の監査報告書

平成24年 5月25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	印
--------------------	-------	------	---

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

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24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。

利害関係

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

以上

(注)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。