

【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 殿 |
| 【提出日】 | 平成25年2月5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】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 長谷川 英男 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【電話番号】 | 03-5555-3111 |
| 【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25年2月6日から平成26年2月4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。 |

第一部 【証券情報】

(1) 【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）

（注1）上記の総称を「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。

（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとします。

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

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。

(4) 【発行（売出）価格】

各ファンドについて、1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

(7) 【申込期間】

平成25年2月6日から平成26年2月4日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる

日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

ニューヨーク証券取引所またはロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受け付けは、行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

委託会社の各営業日（ ）の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日（ ）の取扱いとなります。

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）へ

の記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、内外の公社債、不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

| | | |
|------|---------------|--|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 内外 |
| | 投資対象資産（収益の源泉） | 資産複合 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信））） |
| | 決算頻度 | 年6回（隔月） |
| | 投資対象地域 | グローバル（含む日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし |

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

2. インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、「1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

3. 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

当ファンドは、海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式を実質的な主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、「1. 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じです。

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

- ・「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年6回（隔月）」…目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈各ファンド共通〉

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記1.～3.は、「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）」を構成します。

各ファンドの名称について、次のとおり略称を用いることがあります。

| ファンドの名称 | 略称 |
|-----------------------|---------------|
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 安定重視ポートフォリオ |
| インカム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 |
| 成長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 |

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

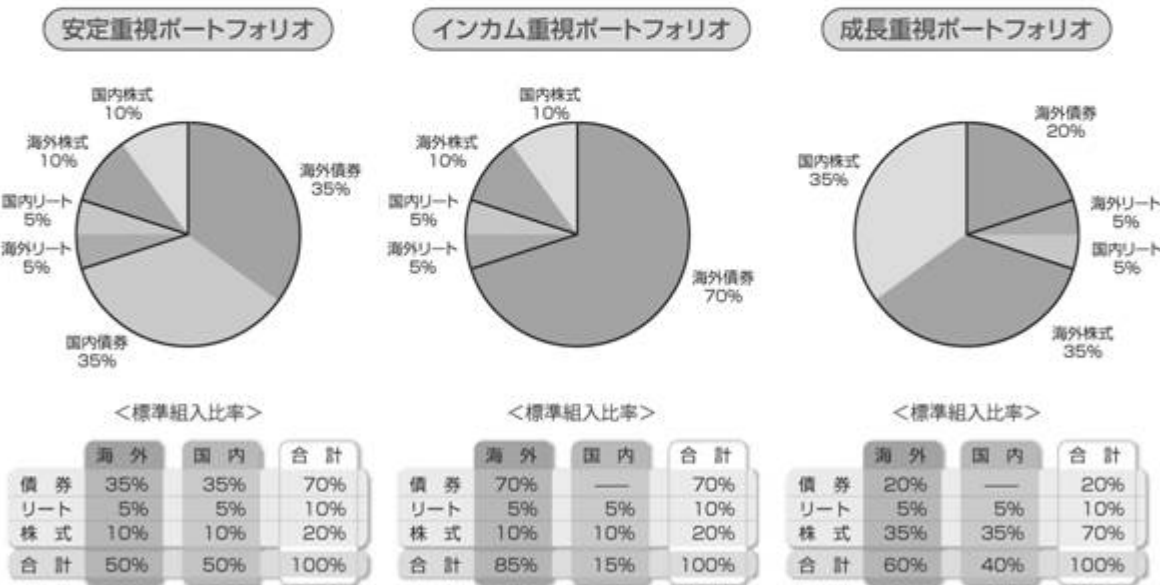
< ファンドの特色 >

1 内外の債券、リートおよび株式に投資します^(注)。

(注) 「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」は、「わが国の債券」に投資しません。

資産配分のイメージ

各ファンド（安定重視ポートフォリオ／インカム重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ）における各資産の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処とします。



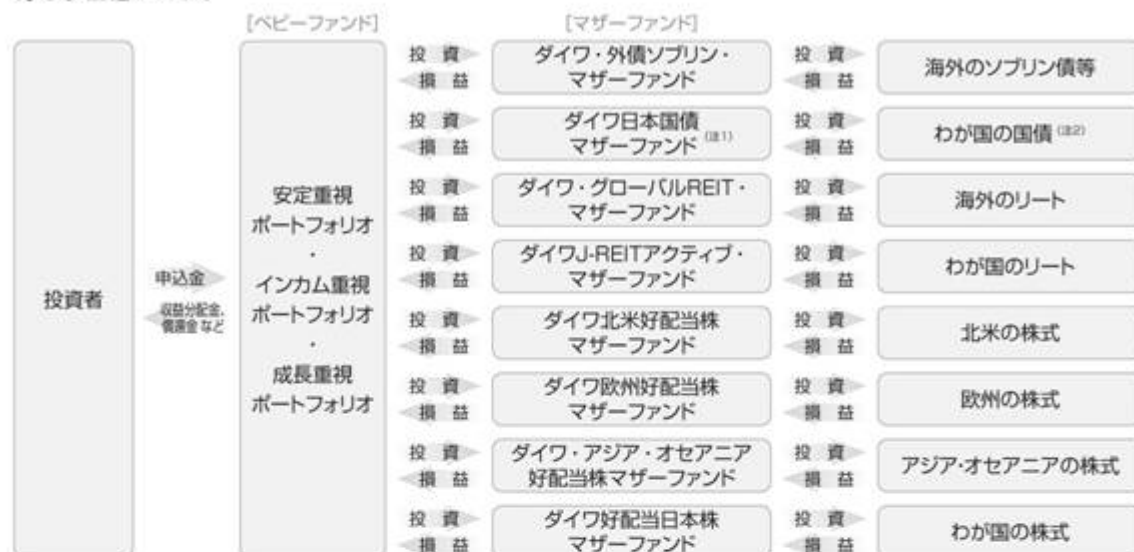
※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



(注1) 「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「ダイワ日本国債マザーファンド」を除きます。

(注2) 「インカム重視ポートフォリオ」および「成長重視ポートフォリオ」については、「わが国の国債」を除きます。

2

海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて

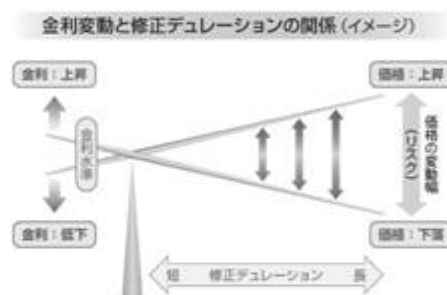


債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ（Moody's）やスタンダード・アンド・プアーズ（S&P）といった格付会社が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

- ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

修正デュレーションについて

- 修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。
- 修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動（ブレ幅）が大きくなります。

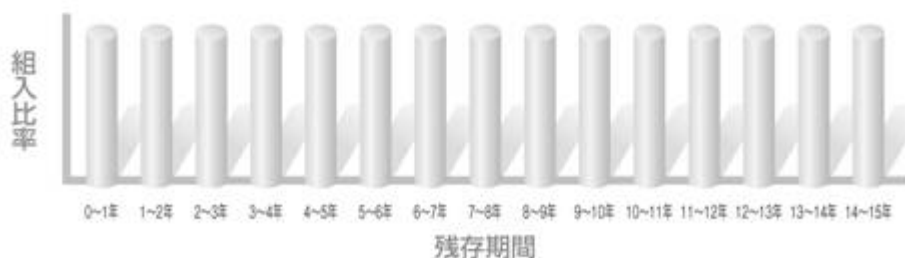


- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

3 わが国の国債への投資にあたっては、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組み入れます。

残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

4

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

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

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

海外のリーートの投資対象地域（イメージ）



投資対象銘柄の業種（イメージ）



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

5

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

- 北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に均等に分散します。

投資対象の地域別構成（イメージ）



投資対象のイメージ



- ◆北米の株式の運用は、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行ないます。

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

- ◆北米の株式への投資にあたっては、株式のほかハイブリッド優先証券®を主要投資対象とします。

※ハイブリッド優先証券とは…

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

〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・優先証券、公益株、バリュー株その他の高配当株の運用にも進出。インカム重視の運用を全般に展開。
- ・リート運用では最大級の資産規模。
- ・ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- ・所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

◆欧州の株式の運用は、バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドが行ないます。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

〈バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて〉

- ・欧州を基盤とした運用グループである「バイオニア・インベストメンツ・グループ」（欧州大手銀行、ウニクレディット・イタリアーノ S.p.A.の100%子会社）の運用拠点の一つ。特に欧州株式、欧州債券の運用に強みを持つ。
- ・運用哲学：リサーチ・チームによるファンダメンタルズ分析、クウォンツ・チームによる定量分析・リスク管理、ポートフォリオ・マネージャーによるアクティブな運用を総合的に生かすことにより、さまざまな投資機会を捉え、グローバルな観点から投資を行ない超過収益の獲得をめざす。
- ・所在地：アイルランド ダブリン

6

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

投資対象のイメージ



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

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

銘柄選定プロセス



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

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

7

毎年、奇数月（1、3、5、7、9、11月）の各10日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

【安定重視ポートフォリオ／成長重視ポートフォリオ】

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

【インカム重視ポートフォリオ】

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 原則として、配当等収益等を中心に継続した分配を行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配を行ないます。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



- 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- 分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

【収益分配金に関する留意事項】

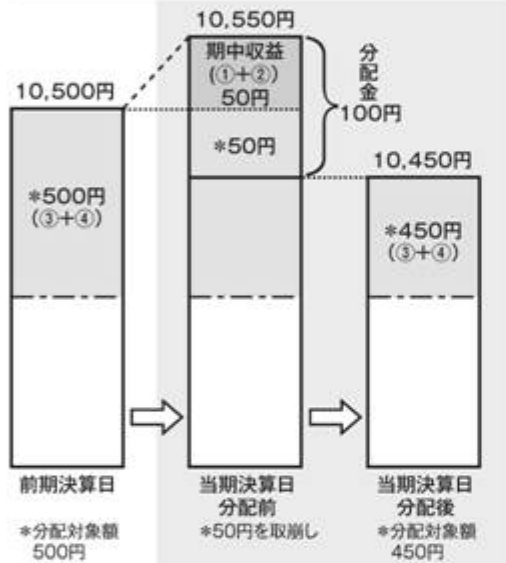
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が
支払われるイメージ

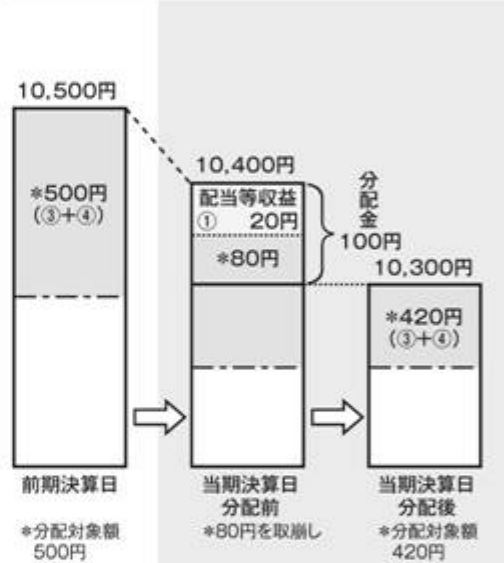
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売却益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)

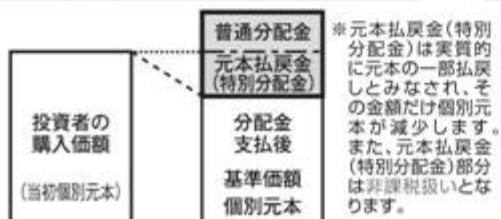


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売却益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

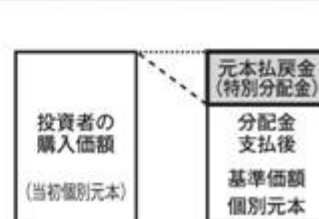
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがいさかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



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

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

(注)普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

(2) 【ファンドの沿革】

平成17年11月14日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

| 収益分配金（注1）、償還金など お申込金（ 5） | |
|--------------------------|--|
| お取扱窓口 | <p>販売会社</p> <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p> |
| 1 | 収益分配金、償還金など お申込金（ 5） |
| 委託会社 | <p>大和証券投資信託委託株式会社</p> <p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p> |
| 運用指図 | 2 損益 信託金（ 5） |
| 受託会社 | <p>三井住友信託銀行株式会社 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</p> <p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p> |
| 投資対象 | <p>損益 投資</p> <p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 などファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p>なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク） ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド） |

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

（注2）投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約（ 3）に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、各マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます（ 4）。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわ

れる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

< 委託会社の概況（平成24年11月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

| | |
|-------------|--|
| 昭和34年12月12日 | 設立登記 |
| 昭和35年 2月17日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得 |
| 昭和35年 4月 1日 | 営業開始 |
| 昭和60年11月 8日 | 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。 |
| 平成 7年 5月31日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。 |
| 平成 7年 9月14日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。 |
| 平成19年 9月30日 | 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号) |

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券（安定重視ポートフォリオのみ）
3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券
6. ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券
7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券
8. ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券

投資態度

< 安定重視ポートフォリオ >

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

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

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

<インカム重視ポートフォリオ>

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の70%

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の3.3%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ハ．～ニ．（安定重視ポートフォリオと同規定）

<成長重視ポートフォリオ>

イ．主として、マザーファンドを通じて海外の公社債ならびに内外の不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、配当等収益の確保と値上がり益の獲得により、信託財産の成長をめざします。

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の20%

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の5%

ダイワ北米好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の11.6%

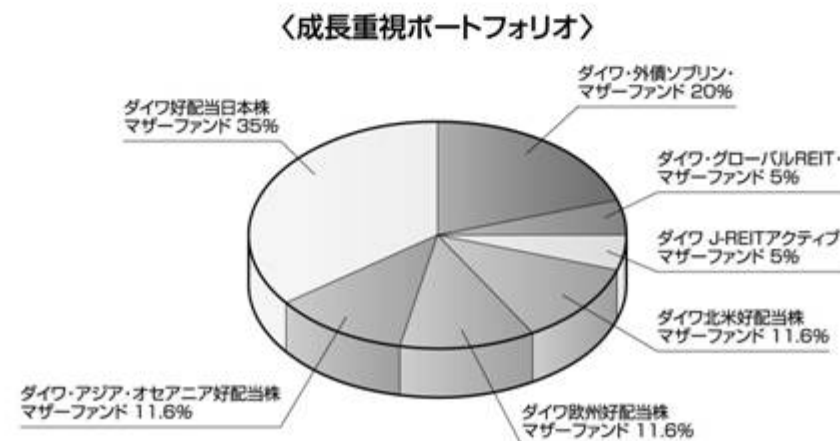
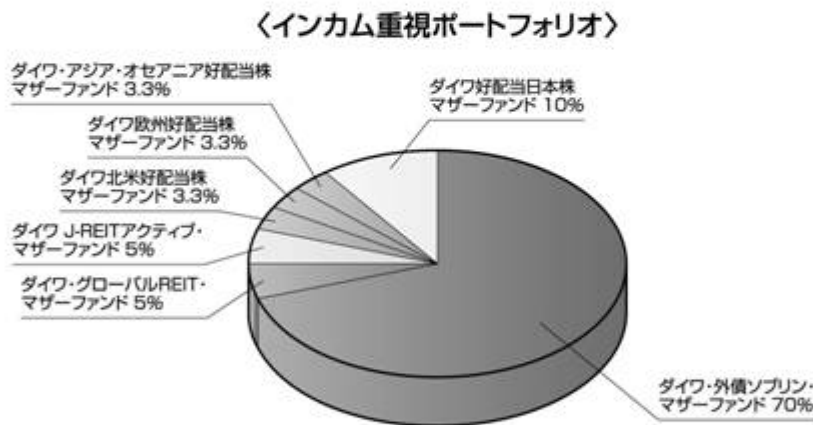
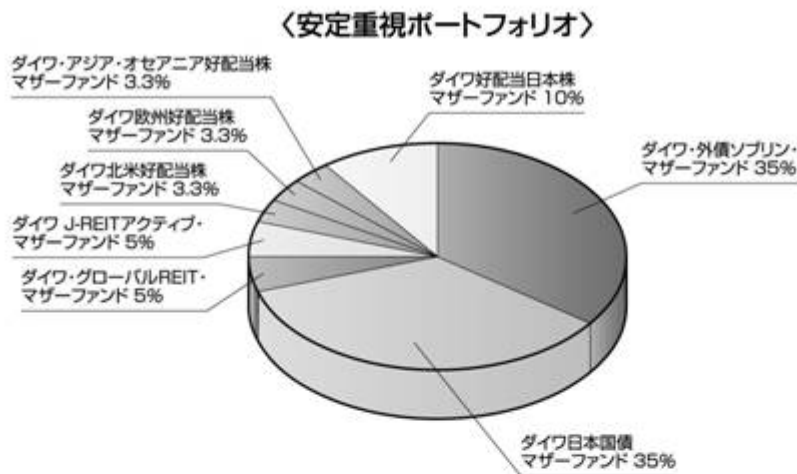
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の11.6%

ダイワ好配当日本株マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の35%

八．～二．（安定重視ポートフォリオと同規定）

〈各マザーファンドの標準組入比率について〉

各ファンド(安定重視ポートフォリオ/インカム重視ポートフォリオ/成長重視ポートフォリオ)における各マザーファンドの受益証券の組入比率については、それぞれ下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。



(2) 【投資対象】

〈各ファンド共通〉

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．約束手形
 - ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和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。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

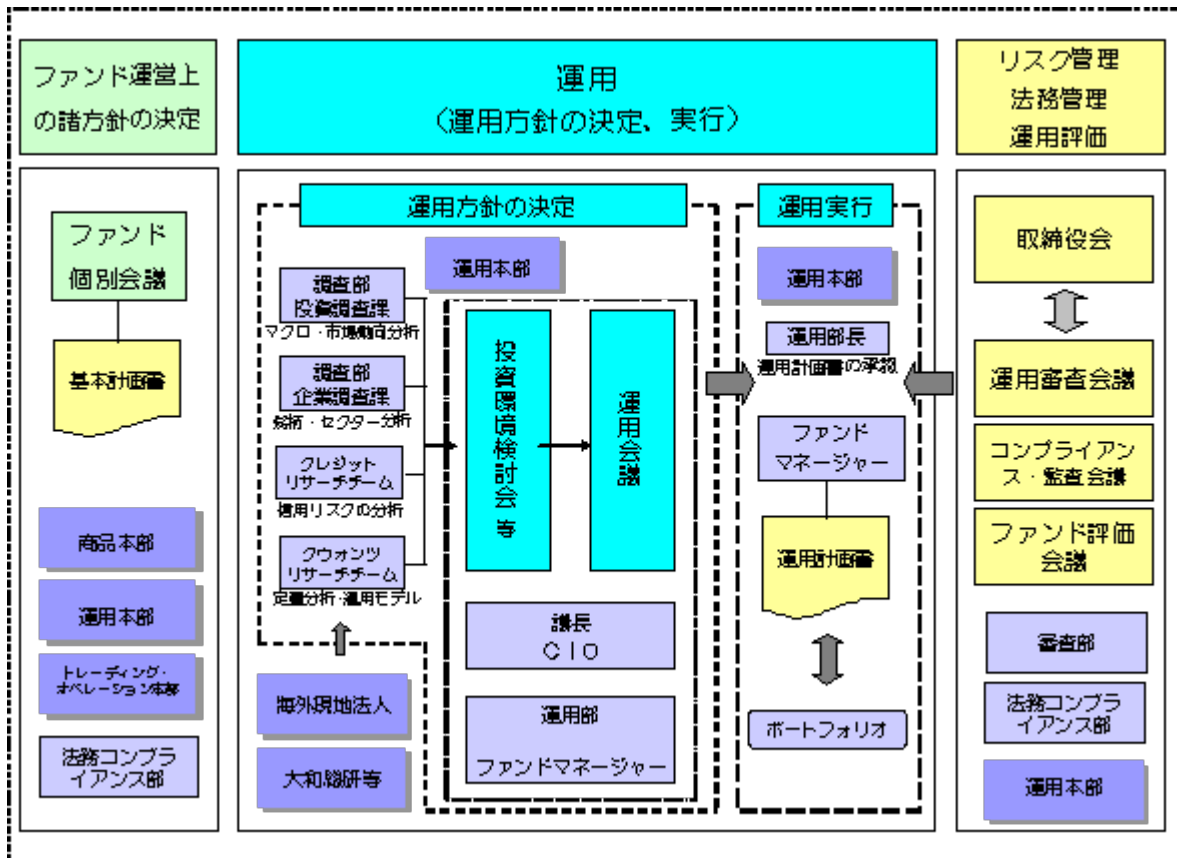
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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。

ハ．基本的な運用方針の決定

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．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．C I O (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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。

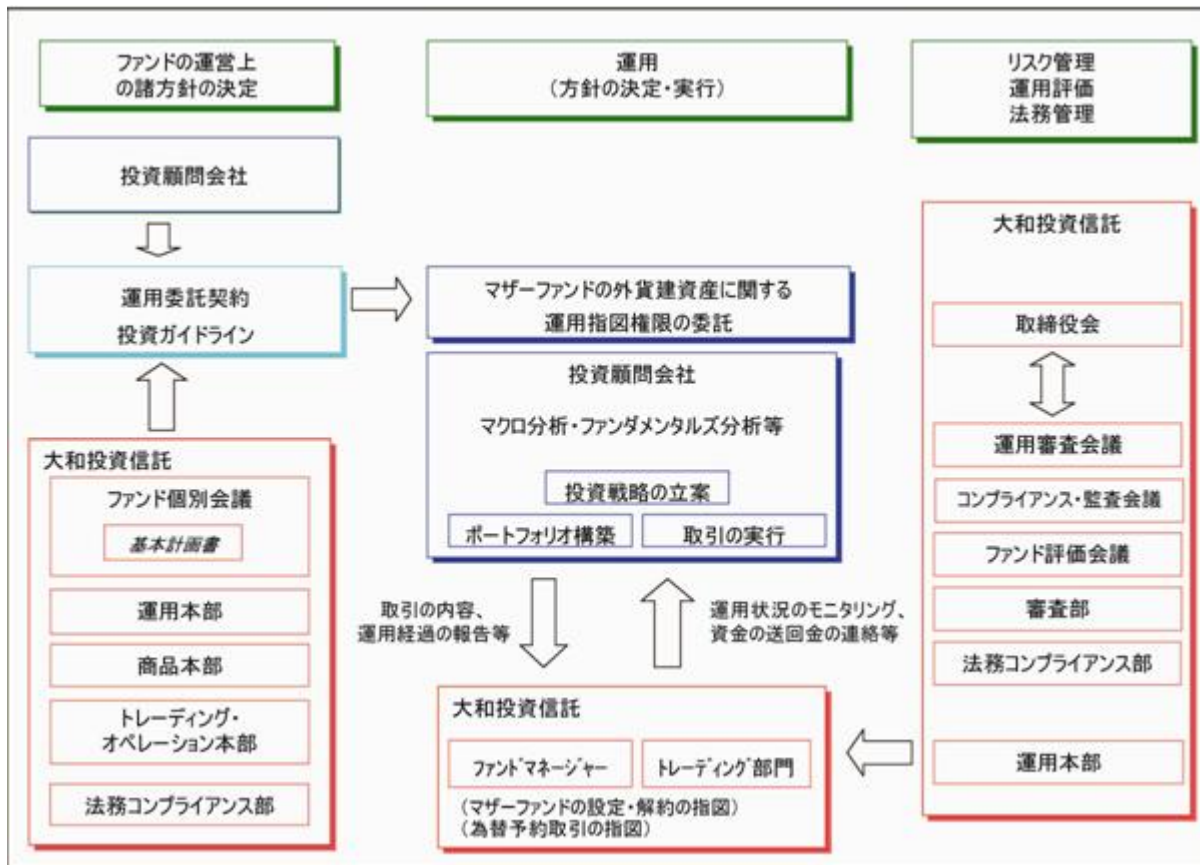
これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

海外リート、海外（北米）株式および海外（欧州）株式にかかる運用体制について

（マザーファンドにかかるものを含まず。）



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も行なっています。これらの報告および調査をもとに評価を行ない、委託会社でのファンド個別会議へ報告しています。

ニ．リスク管理、運用評価、法務管理

(前 に同じ。)

上記の運用体制は平成24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。

(4) 【分配方針】

<安定重視ポートフォリオ / 成長重視ポートフォリオ>

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

原則として、配当等収益等を中心に安定した分配を継続して行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

<インカム重視ポートフォリオ>

（安定重視ポートフォリオ / 成長重視ポートフォリオと同規定）

原則として、配当等収益等を中心に継続した分配を行なうことをめざします。基準価額の水準等によっては、今後の分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配を行ないません。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

（安定重視ポートフォリオ / 成長重視ポートフォリオと同規定）

(5) 【投資制限】

<各ファンド共通>

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券

等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

イ．ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします(ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。)

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

ハ．ポートフォリオの修正デュレーションは5(年)程度から10(年)程度の範囲を基本とします。

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

ホ．為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

以下同じ。）

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

なお、前1. の証券または証書、前8. ならびに前12. の証券または証書のうち前1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2. から前6. までの証券および前8. ならびに前12. の証券または証書のうち前2. から前6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9. の証券およ

び前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

2. ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。

ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

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

1.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

2.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

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

2.~16.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

(3) 主な投資制限

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ロ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドのハ.と同規定)

スワップ取引

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

ロ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

ハ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

ホ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

金利先渡取引

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

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

ハ.(ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定)

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

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

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

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

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

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(4) 運用指図権限の委託

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

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

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

4. **ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド**

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

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

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

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

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

があります。

(2) 投資対象

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

1.（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資方針

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

できるものとしします。

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

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

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ヘ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

ハ．（ダイワ欧州好配当株マザーファンドのニ．と同規定）

ニ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのホ．と同規定）

ホ．（ダイワ北米好配当株マザーファンドのヘ．と同規定）

(2) 投資対象

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとしします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

二．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国の者の発行する証券または証書で、前1.または前5.の証券または証書の性質を有するハイブリッド優先証券
- 13．前12.以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
- 14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 15．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 16．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するもの、および前13.ならびに前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券、前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証

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

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

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

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

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

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

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

(ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定)

(3) 主な投資制限

<各ファンド共通>

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

- 1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- 2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

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

(4) 運用指図権限の委託

<ダイワ北米好配当株マザーファンド>

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

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

パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド

1 ジョージズ・キー・プラザ、ジョージズ・キー、ダブリン2、アイルランド

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

<ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド>

該当事項はありません。

8. ダイワ好配当日本株マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。

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

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

ニ．J-REIT（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

2. ~ 10.（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

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

12. ~ 20.（ダイワ欧州好配当株マザーファンドと同規定）

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

（ダイワ北米好配当株マザーファンドと同規定）

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。

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

とします。

スワップ取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいま

すよう、よろしくお願ひ申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

〈基準価額の主な変動要因〉

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

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

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

ハイブリッド優先証券の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

ハイブリッド優先証券の価格は、金利、発行体の企業業績等を反映して変動します。一般に、金利の上昇、発行体の企業業績の悪化等は、ハイブリッド優先証券の価格下落の要因となると考えられます。

また、ハイブリッド優先証券の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、大きく下落します。この際、ハイブリッド優先証券は一般の債券に比し、弁済順位が劣後するため、影響がより大きくなる可能性があります。

組入ハイブリッド優先証券の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

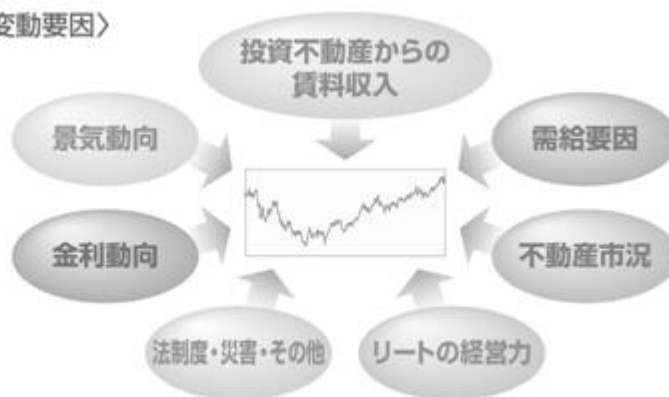


※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リーートの価格変動要因〉



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

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

ロ．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

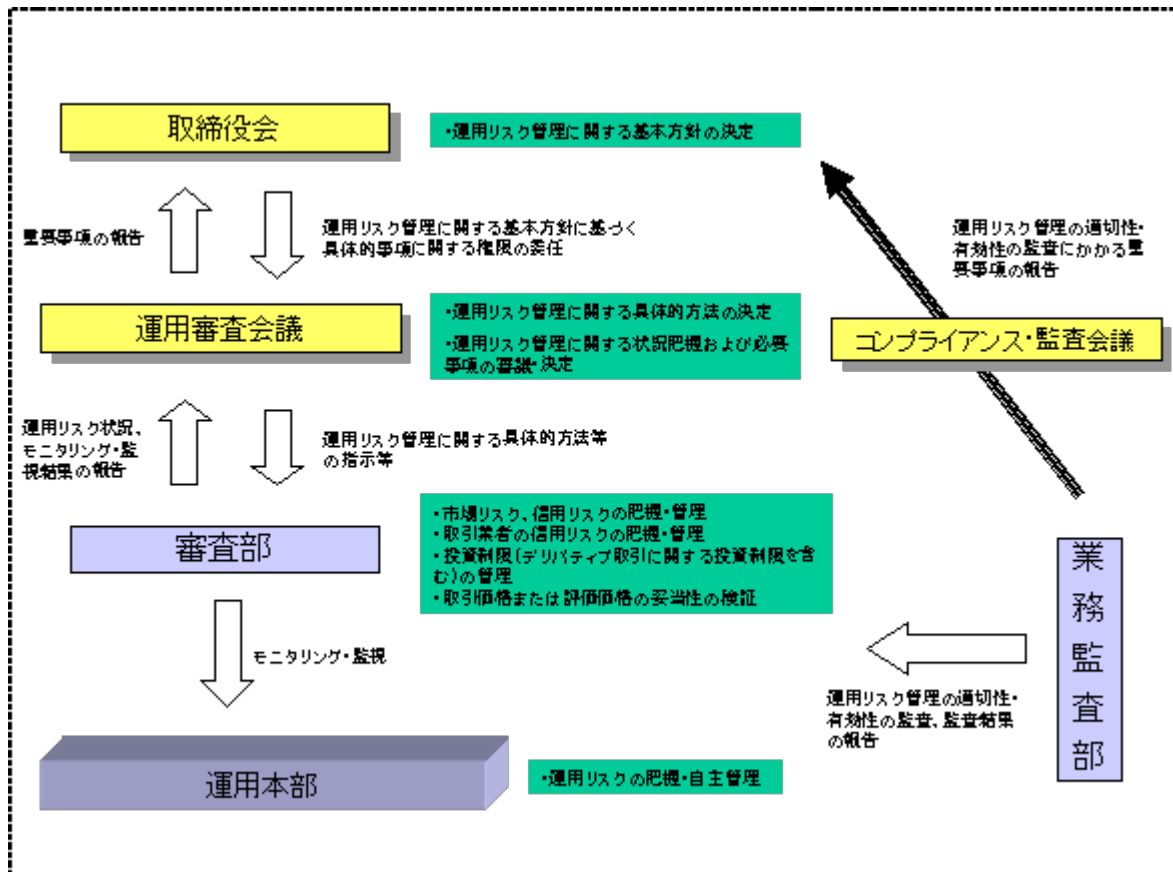
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益

者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

| | |
|---------------|----------------------|
| 安定重視ポートフォリオ | 年率1.26%（税抜1.20%） |
| インカム重視ポートフォリオ | 年率1.33875%（税抜1.275%） |
| 成長重視ポートフォリオ | 年率1.4175%（税抜1.35%） |

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

イ．安定重視ポートフォリオ

| | 委託会社 | 販売会社 （各販売会社の 取扱純資産総額 に応じて） | 受託会社 |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|------------------------|
| 100億円以下の部分 | 年率1.26%（税抜1.20%）から 販売会社、受託会社分を除いた額 | 年率0.6300% （税抜0.60%） | 年率0.0525% （税抜0.05%） |
| 100億円超 200億円以下の部分 | | 年率0.6825% （税抜0.65%） | |
| 200億円超 500億円以下の部分 | | 年率0.7350% （税抜0.70%） | |
| 500億円超 1,000億円以下の部分 | | 年率0.7875% （税抜0.75%） | |
| 1,000億円超の部分 | | 年率0.8400% （税抜0.80%） | |

ロ．インカム重視ポートフォリオ

| | 委託会社 | 販売会社 （各販売会社の 取扱純資産総額 に応じて） | 受託会社 |
|--|------|-------------------------------------|------|
| | | | |

| | | | |
|------------------------|---|------------------------|------------------------|
| 100億円以下の部分 | 年率1.33875%（税抜1.275%） から販売会社、受託会社分を除いた額 | 年率0.6825% （税抜0.65%） | 年率0.0525% （税抜0.05%） |
| 100億円超 200億円以下の部分 | | 年率0.7350% （税抜0.70%） | |
| 200億円超 500億円以下の部分 | | 年率0.7875% （税抜0.75%） | |
| 500億円超 1,000億円以下の部分 | | 年率0.8400% （税抜0.80%） | |
| 1,000億円超の部分 | | 年率0.8925% （税抜0.85%） | |

ハ．成長重視ポートフォリオ

| | 委託会社 | 販売会社 （各販売会社の 取扱純資産総額 に応じて） | 受託会社 |
|------------------------|---|-------------------------------------|------------------------|
| 100億円以下の部分 | 年率1.4175%（税抜1.35%） から販売会社、受託会社分を除いた額 | 年率0.7350% （税抜0.70%） | 年率0.0525% （税抜0.05%） |
| 100億円超 200億円以下の部分 | | 年率0.7875% （税抜0.75%） | |
| 200億円超 500億円以下の部分 | | 年率0.8400% （税抜0.80%） | |
| 500億円超 1,000億円以下の部分 | | 年率0.8925% （税抜0.85%） | |
| 1,000億円超の部分 | | 年率0.9450% （税抜0.90%） | |

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

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

イ．ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

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

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

ロ．ダイワ北米好配当株マザーファンド、ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

| 期間 | 税率 |
|---------------|---------------------------------------|
| 平成25年12月31日まで | 10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%） |
| 平成26年1月1日から | 20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%） |

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

八．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

| 期間 | 税率 |
|---------------|---------------------------------|
| 平成25年12月31日まで | 7.147%（所得税7%および復興特別所得税0.147%） |
| 平成26年1月1日から | 15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%） |

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

<注1> 個別元本について

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

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

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、平成25年1月1日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

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11月30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 | 2,328,078,443 | 99.32 |
| 内 日本 | 2,328,078,443 | 99.32 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 15,873,467 | 0.68 |
| 純資産総額 | 2,343,951,910 | 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11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単 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 | 646,154,611 785,013,239 | 1.2149 | 1.2702 820,745,586 | 35.02 |
| 2 | ダイワ日本国債マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 694,422,129 805,529,679 | 1.1600 | 1.1615 806,571,302 | 34.41 |
| 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 | 218,634,447 220,995,700 | 1.0108 | 1.0732 234,638,488 | 10.01 |
| 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 | 109,893,841 109,542,181 | 0.9968 | 1.0460 114,948,957 | 4.90 |
| 5 | 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 | 99,742,268 109,866,108 | 1.1015 | 1.1466 114,364,484 | 4.88 |
| 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 | 65,009,455 80,150,157 | 1.2329 | 1.3079 85,025,866 | 3.63 |
| 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 | 88,587,998 71,977,748 | 0.8124 | 0.8703 77,098,134 | 3.29 |
| 8 | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 74,240,185 71,099,825 | 0.9577 | 1.0060 74,685,626 | 3.19 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

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 |
| 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 |
| 平成23年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 | - |
| 6月末日 | 2,466,463,690 | - | 0.7503 | - |
| 7月末日 | 2,425,468,950 | - | 0.7467 | - |
| 8月末日 | 2,403,848,628 | - | 0.7514 | - |
| 9月末日 | 2,369,783,096 | - | 0.7521 | - |
| 10月末日 | 2,352,846,961 | - | 0.7615 | - |
| 第14特定期間末 (平成24年11月12日) | 2,292,447,787 | 2,313,809,883 | 0.7512 | 0.7582 |
| 11月末日 | 2,343,951,910 | - | 0.7752 | - |

【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 |
| 第14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 |
| 第14特定期間 | 1.8 |

(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 |
| 第14特定期間 | 17,944,954 | 343,613,359 |

(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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券 | 66,816,549,004 | 89.37 |
| 内 ユーロ | 19,228,127,542 | 25.72 |
| 内 ノルウェー | 674,390,598 | 0.90 |
| 内 スウェーデン | 1,336,498,240 | 1.79 |
| 内 デンマーク | 746,074,022 | 1.00 |
| 内 イギリス | 7,535,039,245 | 10.08 |
| 内 ポーランド | 5,686,331,090 | 7.61 |
| 内 カナダ | 10,450,288,376 | 13.98 |
| 内 アメリカ | 17,172,125,683 | 22.97 |
| 内 オーストラリア | 3,987,674,208 | 5.33 |
| 特殊債券 | 6,214,067,454 | 8.31 |
| 内 オーストラリア | 6,214,067,454 | 8.31 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,736,431,440 | 2.32 |
| 純資産総額 | 74,767,047,898 | 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） | | 182,119,560 | 0.24 |
| | 内 日本 | 182,119,560 | 0.24 |

(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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金 額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単 価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|----------------------------|---------|------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | U.S. TREASURY BOND | アメリカ | 国債証券 | 80,700,000 | 155.78 10,323,737.02 | 156.20 1,704,020 | 8.125000 2021/08/15 | 13.85 |
| 2 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債証券 | 37,600,000 | 178.00 5,537,778.53 | 178.70 5,586,549 | 9.000000 2025/06/01 | 7.44 |
| 3 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 32,000,000 | 146.57 4,997,621.50 | 150.46 2,254,640 | 6.250000 2027/07/15 | 6.86 |
| 4 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 150,000,000 | 106.29 4,155,225.41 | 107.37 1,171,480 | 6.250000 2015/10/24 | 5.61 |
| 5 | UNITED KINGDOM GILT BOND | イギリス | 国債証券 | 19,500,000 | 154.26 3,962,831.34 | 152.97 2,692,221 | 8.000000 2021/06/07 | 5.26 |
| 6 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | オーストラリア | 国債証券 | 32,500,000 | 114.87 3,198,318.31 | 113.67 4,913,235 | 4.750000 2027/04/21 | 4.23 |
| 7 | QUEENSLAND TREASURY CORP. | オーストラリア | 特殊債券 | 30,000,000 | 117.90 3,030,250.79 | 116.03 2,112,731 | 6.000000 2021/06/14 | 3.99 |
| 8 | U.S. TREASURY BOND | アメリカ | 国債証券 | 22,700,000 | 154.75 2,884,731.39 | 155.27 4,481,258 | 8.125000 2021/05/15 | 3.87 |
| 9 | UNITED KINGDOM GILT BOND | イギリス | 国債証券 | 16,600,000 | 127.31 2,784,264.58 | 128.79 2,487,903 | 4.500000 2042/12/07 | 3.77 |
| 10 | BELGIUM GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 20,000,000 | 114.43 2,438,524.40 | 116.71 1,111,410 | 4.000000 2022/03/28 | 3.33 |
| 11 | QUEENSLAND TREASURY CORP. | オーストラリア | 特殊債券 | 25,000,000 | 117.02 2,506,340.10 | 115.26 2,730,972 | 6.250000 2019/06/14 | 3.30 |
| 12 | U.S. TREASURY BOND | アメリカ | 国債証券 | 24,000,000 | 124.41 2,452,120.84 | 124.11 2,197,129 | 11.250000 2015/02/15 | 3.27 |
| 13 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 17,000,000 | 122.85 2,225,381.29 | 127.17 2,638,703 | 4.150000 2037/03/15 | 3.08 |
| 14 | GERMAN GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 11,000,000 | 156.85 1,838,465.90 | 159.49 1,302,545 | 6.500000 2027/07/04 | 2.50 |
| 15 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債証券 | 12,800,000 | 173.37 1,836,166.08 | 174.63 1,457,433 | 8.000000 2027/06/01 | 2.47 |
| 16 | GERMAN GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 10,500,000 | 159.37 1,783,100.39 | 160.39 1,470,349 | 6.250000 2030/01/04 | 2.40 |
| 17 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 10,000,000 | 158.55 1,689,382.17 | 160.22 1,186,720 | 8.500000 2023/04/25 | 2.28 |
| 18 | GERMAN GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 13,500,000 | 116.65 1,678,037.88 | 117.21 1,992,326 | 3.250000 2021/07/04 | 2.25 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------|---------|------|-------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|------|
| 19 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債証券 | 12,000,000 | 158.63 1,575,023,758 | 159.45 1,588,236,519 | 8.000000 2023/06/01 | 2.12 |
| 20 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 50,000,000 | 109.17 1,422,568,498 | 114.28 1,459,159,610 | 5.750000 2022/09/23 | 1.99 |
| 21 | SWEDISH GOVERNMENT BOND | スウェーデン | 国債証券 | 100,000,000 | 109.39 1,347,746,486 | 108.48 1,365,498,240 | 6.750000 2014/05/05 | 1.79 |
| 22 | GERMAN GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 10,000,000 | 116.97 1,246,357,926 | 117.82 1,254,404,065 | 4.250000 2017/07/04 | 1.68 |
| 23 | U.S. TREASURY BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000 | 147.08 966,289,916 | 146.88 964,955,987 | 8.125000 2019/08/15 | 1.29 |
| 24 | CANADIAN GOVERNMENT BOND | カナダ | 国債証券 | 9,000,000 | 115.22 857,997,252 | 115.33 858,816,378 | 4.250000 2018/06/01 | 1.15 |
| 25 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | オーストラリア | 国債証券 | 8,000,000 | 120.99 829,251,382 | 120.04 822,760,972 | 5.500000 2023/04/21 | 1.10 |
| 26 | UNITED KINGDOM GILT BOND | イギリス | 国債証券 | 4,000,000 | 150.41 792,600,578 | 149.70 788,859,120 | 6.000000 2028/12/07 | 1.06 |
| 27 | QUEENSLAND TREASURY CORP. | オーストラリア | 特殊債券 | 8,000,000 | 113.03 774,682,968 | 111.36 768,223,749 | 6.000000 2017/09/14 | 1.02 |
| 28 | DANISH GOVERNMENT BOND | デンマーク | 国債証券 | 32,000,000 | 161.61 738,498,766 | 163.26 746,074,022 | 7.000000 2024/11/10 | 1.00 |
| 29 | BELGIUM GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 5,000,000 | 132.41 705,462,228 | 134.84 718,392,065 | 5.500000 2028/03/28 | 0.96 |
| 30 | U.S. TREASURY BOND | アメリカ | 国債証券 | 4,000,000 | 155.68 511,400,657 | 156.71 514,787,286 | 7.625000 2022/11/15 | 0.69 |

(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 | 89.37% |
| 特殊債券 | 8.31% |
| 合計 | 97.68% |

(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 | ユーロ売/円買 2012年12月 | 売建 | 600,000 | 63,930,360 | 63,924,000 | 0.09% |
| | | デンマーク・クローネ売/ 円買 2012年12月 | 売建 | 8,277,000 | 117,785,848 | 118,195,560 | 0.16% |

(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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 303,630,980,669 | 99.03 |
| 内 日本 | 303,630,980,669 | 99.03 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,961,029,685 | 0.97 |
| 純資産総額 | 306,592,010,354 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単 価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|----------------|----|------|----------------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | 2 3 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 12,690,000,000 | 107.62 13,657,900,289 | 104.29 10,527,899 | 5.500000 2013/09/20 | 4.32 |
| 2 | 6 4 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 11,285,000,000 | 109.80 12,391,438,800 | 111.20 10,597,100 | 1.900000 2023/09/20 | 4.09 |
| 3 | 2 7 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 11,046,000,000 | 111.36 12,301,062,000 | 108.80 10,489,840 | 5.000000 2014/09/22 | 3.92 |
| 4 | 9 7 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 10,450,000,000 | 111.91 11,694,768,500 | 112.56 10,833,500 | 2.200000 2027/09/20 | 3.84 |
| 5 | 4 3 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 9,962,000,000 | 116.68 11,623,826,600 | 117.19 10,965,900 | 2.900000 2019/09/20 | 3.81 |
| 6 | 6 8 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 9,705,000,000 | 112.55 10,923,638,600 | 114.26 10,933,000 | 2.200000 2024/03/20 | 3.62 |
| 7 | 3 4 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 9,609,000,000 | 115.50 11,099,280,980 | 114.32 10,873,610 | 3.500000 2017/03/20 | 3.58 |
| 8 | 3 8 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 9,386,000,000 | 113.52 10,655,268,300 | 113.20 10,515,160 | 2.700000 2018/03/20 | 3.47 |
| 9 | 2 8 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 9,488,000,000 | 114.15 10,831,110,360 | 111.21 10,604,800 | 5.000000 2015/03/20 | 3.44 |
| 10 | 4 7 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 9,160,000,000 | 112.46 10,302,038,380 | 113.35 10,134,800 | 2.200000 2020/09/21 | 3.39 |
| 11 | 3 3 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 9,074,000,000 | 115.74 10,502,980,630 | 113.90 10,286,000 | 3.800000 2016/09/20 | 3.37 |
| 12 | 3 2 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 8,943,000,000 | 113.59 10,158,979,000 | 111.77 10,395,970 | 3.700000 2016/03/21 | 3.26 |
| 13 | 4 4 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,495,000,000 | 114.57 9,733,420,620 | 115.07 9,961,050 | 2.500000 2020/03/20 | 3.19 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------|----|------|---------------|-------------------------|-------------------|------------------------|------|
| 14 | 2 9 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 8,640,000,000 | 113.72 9,826,109,629 | 111.45 452,800 | 4.200000 2015/09/21 | 3.14 |
| 15 | 4 0 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,482,000,000 | 111.70 9,474,909,400 | 111.90 358,000 | 2.300000 2018/09/20 | 3.10 |
| 16 | 7 0 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,998,000,000 | 113.93 9,112,769,300 | 116.41 791,720 | 2.400000 2024/06/20 | 3.04 |
| 17 | 5 8 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 8,355,000,000 | 108.59 9,073,342,200 | 111.30 532,750 | 1.900000 2022/09/20 | 3.03 |
| 18 | 4 2 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,478,000,000 | 113.98 8,523,548,300 | 114.51 656,040 | 2.600000 2019/03/20 | 2.79 |
| 19 | 9 5 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,455,000,000 | 113.13 8,434,078,300 | 114.04 905,650 | 2.300000 2027/06/20 | 2.77 |
| 20 | 2 4 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 7,794,000,000 | 108.51 8,457,788,200 | 105.93 573,900 | 4.700000 2014/03/20 | 2.69 |
| 21 | 5 2 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 7,168,000,000 | 111.07 7,962,158,500 | 113.00 270,080 | 2.100000 2021/09/21 | 2.64 |
| 22 | 3 7 利付国債 2 0 年 | 日本 | 国債証券 | 6,823,000,000 | 114.94 7,842,960,870 | 113.96 559,030 | 3.100000 2017/09/20 | 2.54 |
| 23 | 4 8 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,581,000,000 | 114.35 7,525,617,005 | 115.87 667,940 | 2.500000 2020/12/21 | 2.49 |
| 24 | 6 3 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,908,000,000 | 108.34 7,484,569,600 | 110.25 622,640 | 1.800000 2023/06/20 | 2.48 |
| 25 | 9 1 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 6,020,000,000 | 111.83 6,732,706,800 | 114.44 348,200 | 2.300000 2026/09/20 | 2.25 |
| 26 | 5 6 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,510,000,000 | 110.48 6,087,900,000 | 112.23 873,000 | 2.000000 2022/06/20 | 2.02 |
| 27 | 8 2 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 5,095,000,000 | 110.41 5,625,413,350 | 112.60 224,750 | 2.100000 2025/09/20 | 1.87 |
| 28 | 7 4 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,905,000,000 | 109.84 5,387,745,300 | 113.03 562,950 | 2.100000 2024/12/20 | 1.81 |
| 29 | 8 6 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,430,000,000 | 111.71 4,949,088,000 | 114.77 709,700 | 2.300000 2026/03/20 | 1.66 |
| 30 | 8 0 2 0 年国債 | 日本 | 国債証券 | 4,403,000,000 | 110.03 4,845,034,000 | 112.76 866,830 | 2.100000 2025/06/20 | 1.62 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 国債証券 | 99.03% |
| 合計 | 99.03% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 投資証券 | 200,299,464,108 | 98.03 |
| 内 香港 | 8,944,337,952 | 4.38 |
| 内 シンガポール | 10,665,897,212 | 5.22 |
| 内 イギリス | 20,461,101,018 | 10.01 |
| 内 オランダ | 3,710,070,733 | 1.82 |
| 内 フランス | 16,123,542,181 | 7.89 |
| 内 ドイツ | 581,614,588 | 0.28 |
| 内 カナダ | 6,931,614,846 | 3.39 |
| 内 アメリカ | 92,463,554,519 | 45.25 |
| 内 オーストラリア | 40,417,731,059 | 19.78 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 4,025,248,034 | 1.97 |
| 純資産総額 | 204,324,712,142 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 2,049,629,929 | 1.00 |
| 内 日本 | 2,049,629,929 | 1.00 |
| 為替予約取引（売建） | 3,032,316,074 | 1.48 |
| 内 日本 | 3,032,316,074 | 1.48 |

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

(注2) 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金 額 | 簿価単 価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|--------------------------|-------------|------|------------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------|
| 1 | WESTFIELD GROUP | オーストラ リア | 投資証券 | 12,013,175 10,312,270,397 | 858.41 2,270,397 | 894.39 10,744,521,251 | 5.26 |
| 2 | UNIBAIL-RODAMCO SE | フランス | 投資証券 | 526,073 9,175,888,893 | 17,442.23 888,893 | 19,253.58 10,128,791,222 | 4.96 |
| 3 | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ | 投資証券 | 813,773 10,928,225,648 | 13,429.08 225,648 | 12,420.65 10,107,589,612 | 4.95 |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------|-------------|------|---------------------|----------------------|----------------------------|------|
| 4 | LINK REIT | 香港 | 投資証券 | 14,956,920 5,723 | 382.66 415,007 | 446.26 6,674,675,119 | 3.27 |
| 5 | WESTFIELD RETAIL TRUST | オーストラ リア | 投資証券 | 23,401,412 5,914 | 252.72 156,950 | 255.29 5,974,300,919 | 2.92 |
| 6 | LAND SECURITIES GROUP PLC | イギリス | 投資証券 | 5,291,188 5,552 | 1,049.30 091,718 | 1,055.23 5,583,459,468 | 2.73 |
| 7 | GPT GROUP | オーストラ リア | 投資証券 | 16,105,887 4,815 | 298.98 471,774 | 299.84 4,829,269,688 | 2.36 |
| 8 | HAMMERSON PLC | イギリス | 投資証券 | 7,329,746 4,510 | 615.35 414,467 | 616.54 4,519,105,054 | 2.21 |
| 9 | VORNADO REALTY TRUST | アメリカ | 投資証券 | 720,597 5,008 | 6,950.63 608,026 | 6,227.98 4,487,864,281 | 2.20 |
| 10 | STOCKLAND | オーストラ リア | 投資証券 | 14,518,780 4,129 | 284.42 495,290 | 293.84 4,266,315,917 | 2.09 |
| 11 | HCP INC | アメリカ | 投資証券 | 1,121,109 4,266 | 3,805.19 046,426 | 3,692.93 4,140,184,234 | 2.03 |
| 12 | BRITISH LAND CO PLC | イギリス | 投資証券 | 5,704,148 4,099 | 718.64 238,618 | 715.34 4,080,452,004 | 2.00 |
| 13 | CAPITAMALL TRUST | シンガポ ール | 投資証券 | 28,556,192 3,795 | 132.91 617,650 | 139.31 3,978,191,664 | 1.95 |
| 14 | PROLOGIS INC | アメリカ | 投資証券 | 1,406,668 4,235 | 3,011.34 956,178 | 2,793.72 3,929,839,901 | 1.92 |
| 15 | VENTAS INC | アメリカ | 投資証券 | 739,545 3,948 | 5,338.70 222,077 | 5,221.18 3,861,304,663 | 1.89 |
| 16 | MIRVAC GROUP | オーストラ リア | 投資証券 | 28,587,011 3,538 | 123.79 876,140 | 125.50 3,587,857,125 | 1.76 |
| 17 | DEXUS PROPERTY GROUP | オーストラ リア | 投資証券 | 41,503,944 3,395 | 81.81 638,953 | 83.95 3,484,530,025 | 1.71 |
| 18 | EQUITY RESIDENTIAL | アメリカ | 投資証券 | 732,433 3,623 | 4,946.90 279,253 | 4,578.19 3,353,217,436 | 1.64 |
| 19 | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | アメリカ | 投資証券 | 1,582,253 3,565 | 2,253.37 405,873 | 2,074.35 3,282,148,409 | 1.61 |
| 20 | KLEPIERRE | フランス | 投資証券 | 1,051,879 3,166 | 3,010.25 502,357 | 3,118.71 3,280,514,497 | 1.61 |
| 21 | CAPITACOMMERCIAL TRUST | シンガポ ール | 投資証券 | 28,286,800 2,699 | 95.43 617,163 | 107.68 3,045,922,624 | 1.49 |
| 22 | RIOCAN REIT | カナダ | 投資証券 | 1,373,212 3,163 | 2,303.48 168,575 | 2,206.67 3,030,233,689 | 1.48 |
| 23 | GENERAL GROWTH PROPERTIES | アメリカ | 投資証券 | 1,856,062 3,048 | 1,642.40 396,229 | 1,569.31 2,912,742,597 | 1.43 |
| 24 | GOODMAN GROUP | オーストラ リア | 投資証券 | 6,986,012 2,473 | 353.98 218,486 | 395.79 2,765,031,414 | 1.35 |
| 25 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 投資証券 | 237,397 2,879 | 12,128.30 222,700 | 11,601.91 2,754,259,483 | 1.35 |
| 26 | HOST HOTELS & RESORTS INC | アメリカ | 投資証券 | 2,265,316 3,201 | 1,413.28 537,576 | 1,206.34 2,732,747,646 | 1.34 |
| 27 | CENTRO RETAIL AUSTRALIA | オーストラ リア | 投資証券 | 14,574,000 2,685 | 184.19 611,593 | 185.04 2,696,877,893 | 1.32 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------|------|------|---------------------|---------------------|---------------------------|------|
| 28 | CORIO NV | オランダ | 投資証券 | 728,309 2,699 | 3,706.66 660,891 | 3,649.33 2,657,845,345 | 1.30 |
| 29 | SL GREEN REALTY CORP | アメリカ | 投資証券 | 384,675 2,650 | 6,890.68 675,868 | 6,108.08 2,349,627,828 | 1.15 |
| 30 | CHAMPION REIT | 香港 | 投資証券 | 54,207,376 1,999 | 36.88 601,686 | 41.87 2,269,662,833 | 1.11 |

(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 | 98.03% |
| 合計 | 98.03% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|----------------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2012年12月 | 買建 | 24,471,757 | 2,008,623,520 | 2,009,375,948 | 0.98% |
| | | シンガポール・ドル買/円 売 2012年12月 | 買建 | 598,216 | 40,256,929 | 40,253,981 | 0.02% |
| | | 豪ドル売/円買 2012年12月 | 売建 | 17,670,289 | 1,516,175,625 | 1,513,224,976 | 0.74% |
| | | ユーロ売/円買 2012年12月 | 売建 | 636,479 | 67,814,784 | 67,810,459 | 0.03% |
| | | シンガポール・ドル売/円 買 2012年12月 | 売建 | 6,326,477 | 424,633,111 | 425,708,612 | 0.21% |
| | | 米ドル売/円買 2012年12月 | 売建 | 12,490,221 | 1,025,675,329 | 1,025,572,027 | 0.50% |

(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11月30日現在)

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券 | 11,717,062,500 | 96.78 |
| 内 日本 | 11,717,062,500 | 96.78 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 390,399,024 | 3.22 |

| | | |
|-------|----------------|--------|
| 純資産総額 | 12,107,461,524 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 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 | 1,900 1,609,300,000 | 847,000.00 | 863,000.00 1,639,700,000 | 13.54 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 投資証券 | 1,771 1,390,235,000 | 785,000.00 | 810,000.00 1,434,510,000 | 11.85 |
| 3 | 森トラスト総合リート | 日本 | 投資証券 | 1,170 826,251,673 | 706,197.99 | 692,000.00 809,640,000 | 6.69 |
| 4 | 日本リテールファンド | 日本 | 投資証券 | 5,200 743,600,000 | 143,000.00 | 150,000.00 780,000,000 | 6.44 |
| 5 | アドバンス・レジデンス | 日本 | 投資証券 | 3,300 538,560,000 | 163,200.00 | 172,900.00 570,570,000 | 4.71 |
| 6 | 野村不動産オフィスF | 日本 | 投資証券 | 1,100 518,100,000 | 471,000.00 | 493,500.00 542,850,000 | 4.48 |
| 7 | フロンティア不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 650 440,050,000 | 677,000.00 | 705,000.00 458,250,000 | 3.78 |
| 8 | 森ヒルズリート | 日本 | 投資証券 | 1,000 379,000,000 | 379,000.00 | 421,000.00 421,000,000 | 3.48 |
| 9 | 日本プライムリアルティ | 日本 | 投資証券 | 1,700 395,590,000 | 232,700.00 | 243,800.00 414,460,000 | 3.42 |
| 10 | 産業ファンド | 日本 | 投資証券 | 650 394,550,000 | 607,000.00 | 637,000.00 414,050,000 | 3.42 |
| 11 | A P I 投資法人 | 日本 | 投資証券 | 800 415,200,000 | 519,000.00 | 511,000.00 408,800,000 | 3.38 |
| 12 | ジャパンエクセレント投資法人 | 日本 | 投資証券 | 780 334,620,000 | 429,000.00 | 461,000.00 359,580,000 | 2.97 |
| 13 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 3,700 353,720,000 | 95,600.00 | 93,500.00 345,950,000 | 2.86 |
| 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 | 550 298,650,000 | 543,000.00 | 588,000.00 323,400,000 | 2.67 |
| 15 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 日本 | 投資証券 | 500 300,000,000 | 600,000.00 | 630,000.00 315,000,000 | 2.60 |
| 16 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 12,000 268,800,000 | 22,400.00 | 24,090.00 289,080,000 | 2.39 |
| 17 | オリックス不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 650 244,725,000 | 376,500.00 | 412,500.00 268,125,000 | 2.21 |
| 18 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 1,000 250,000,000 | 250,000.00 | 266,400.00 266,400,000 | 2.20 |
| 19 | 野村不レジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 500 236,250,000 | 472,500.00 | 463,000.00 231,500,000 | 1.91 |

| | | | | | | |
|----|-------------------|----|------|-----------------------------------|---------------------------|------|
| 20 | 日本賃貸住宅投資法人 | 日本 | 投資証券 | 4,170 46,500.00 193,905,000 | 54,500.00 227,265,000 | 1.88 |
| 21 | 福岡リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 350 581,000.00 203,350,000 | 605,000.00 211,750,000 | 1.75 |
| 22 | いちご不動産投資法人 | 日本 | 投資証券 | 4,700 40,950.00 192,465,000 | 43,850.00 206,095,000 | 1.70 |
| 23 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 250 710,000.00 177,500,000 | 721,000.00 180,250,000 | 1.49 |
| 24 | ケネディクス不動産投資法人 | 日本 | 投資証券 | 600 265,000.00 159,000,000 | 273,500.00 164,100,000 | 1.36 |
| 25 | 平和不動産リート | 日本 | 投資証券 | 3,000 53,600.00 160,800,000 | 54,000.00 162,000,000 | 1.34 |
| 26 | プレミア投資法人 | 日本 | 投資証券 | 300 282,100.00 84,630,000 | 300,000.00 90,000,000 | 0.74 |
| 27 | 東急リアル・エステート | 日本 | 投資証券 | 150 437,126.03 65,568,905 | 444,000.00 66,600,000 | 0.55 |
| 28 | 積水ハウス・S I 投資法人 | 日本 | 投資証券 | 175 375,990.77 65,798,386 | 378,500.00 66,237,500 | 0.55 |
| 29 | グローバル・ワン不動産投資法人 | 日本 | 投資証券 | 100 459,500.00 45,950,000 | 499,000.00 49,900,000 | 0.41 |

(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 | 96.78% |
| 合計 | 96.78% |

(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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---------|--------|---------------|---------|
| 株式 | | 1,463,800,173 | 71.07 |
| | 内 カナダ | 109,435,666 | 5.31 |
| | 内 アメリカ | 1,354,364,507 | 65.76 |

| | | |
|-----------------------|---------------|--------|
| ハイブリッド優先証券 | 447,122,089 | 21.71 |
| 内 アメリカ | 447,122,089 | 21.71 |
| 投資証券 | 43,783,864 | 2.13 |
| 内 アメリカ | 43,783,864 | 2.13 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 104,960,085 | 5.10 |
| 純資産総額 | 2,059,666,211 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、 口数 または 額 面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|-----------------------------|------|----|----------------|------------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 925 | 50,789.74 46,980,550 | 48,398.24 44,768,375 | 2.17 |
| 2 | CHEVRON CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 5,100 | 9,162.86 46,730,920 | 8,687.47 44,306,121 | 2.15 |
| 3 | EXXON MOBIL CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 5,500 | 7,475.38 41,114,610 | 7,236.41 39,800,279 | 1.93 |
| 4 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 5,100 | 7,530.40 38,405,060 | 7,417.89 37,831,288 | 1.84 |
| 5 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 11,000 | 3,417.83 37,596,178 | 3,384.98 37,234,850 | 1.81 |
| 6 | CISCO SYSTEMS INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 23,200 | 1,485.55 34,465,214 | 1,561.10 36,217,548 | 1.76 |
| 7 | MCDONALD'S CORP | アメリカ | 株式 | 一般消費財 ・サービス | 4,900 | 7,596.92 37,224,914 | 7,102.55 34,802,538 | 1.69 |
| 8 | ORACLE CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 13,200 | 2,545.72 33,603,504 | 2,614.70 34,514,051 | 1.68 |
| 9 | CVS CAREMARK CORP | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 8,800 | 3,857.01 33,941,752 | 3,805.44 33,487,879 | 1.63 |
| 10 | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 14,600 | 2,397.90 35,009,398 | 2,213.13 32,311,756 | 1.57 |
| 11 | QUALCOMM INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 5,900 | 4,836.04 28,532,676 | 5,202.30 30,693,582 | 1.49 |
| 12 | UNITED PARCEL SERVICE-CL B | アメリカ | 株式 | 資本財・ サービス | 5,000 | 5,921.67 29,608,366 | 6,040.74 30,203,736 | 1.47 |
| 13 | UNITEDHEALTH GROUP INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 6,600 | 4,686.58 30,931,483 | 4,464.04 29,462,685 | 1.43 |
| 14 | PFIZER INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 13,900 | 2,062.85 28,673,676 | 2,040.68 28,365,480 | 1.38 |
| 15 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 1,800 | 17,064.53 30,716,165 | 15,728.44 28,311,198 | 1.37 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------|----------------|----------------|--------|-------------------------|-------------------------|------|
| 16 | AT&T INC | アメリカ | 株式 | 電気通信 サービス | 10,000 | 2,925.93 29,259,356 | 2,786.33 27,863,316 | 1.35 |
| 17 | TIME WARNER CABLE | アメリカ | 株式 | 一般消費財 ・サービス | 3,500 | 7,954.14 27,839,501 | 7,729.95 27,054,845 | 1.31 |
| 18 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 2,100 | 11,424.53 23,991,522 | 12,168.54 25,553,937 | 1.24 |
| 19 | QWEST CORPORATION 7.0 B | アメリカ | ハイブリッド 優先証券 | - | 11,000 | 2,209.84 24,308,341 | 2,176.18 23,937,980 | 1.16 |
| 20 | US BANCORP VAR | アメリカ | ハイブリッド 優先証券 | - | 10,000 | 2,461.95 24,619,576 | 2,391.33 23,913,344 | 1.16 |
| 21 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 4,000 | 5,581.69 22,326,786 | 5,684.34 22,737,386 | 1.10 |
| 22 | WELLS FARGO & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 8,300 | 2,812.61 23,344,663 | 2,723.09 22,601,723 | 1.10 |
| 23 | BLACKROCK INC | アメリカ | 株式 | 金融 | 1,400 | 15,135.53 21,189,752 | 16,064.31 22,490,040 | 1.09 |
| 24 | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | カナダ | 株式 | 電気通信 サービス | 6,200 | 3,351.79 20,781,144 | 3,611.60 22,391,926 | 1.09 |
| 25 | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | アメリカ | 株式 | 資本財・ サービス | 3,500 | 5,938.91 20,786,214 | 6,360.19 22,260,679 | 1.08 |
| 26 | MERCK & CO. INC. | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 6,000 | 3,746.31 22,477,886 | 3,671.58 22,029,511 | 1.07 |
| 27 | COVIDIEN PLC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 4,600 | 4,741.60 21,811,400 | 4,780.20 21,988,944 | 1.07 |
| 28 | PEPSICO INC | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 3,800 | 5,752.50 21,859,523 | 5,773.85 21,940,657 | 1.07 |
| 29 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 3,500 | 6,701.73 23,456,264 | 6,262.47 21,918,649 | 1.06 |
| 30 | WALT DISNEY CO | アメリカ | 株式 | 一般消費財 ・サービス | 5,300 | 4,154.45 22,018,589 | 4,083.00 21,639,934 | 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 | 71.07% |
| ハイブリッド優先証券 | 21.71% |
| 投資証券 | 2.13% |
| 合計 | 94.90% |

(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 | 9.38% |
| 素材 | 2.11% |
| 資本財・サービス | 7.85% |
| 一般消費財・サービス | 7.47% |
| 生活必需品 | 6.82% |
| ヘルスケア | 7.61% |

| | |
|----------|--------|
| 金融 | 11.34% |
| 情報技術 | 13.62% |
| 電気通信サービス | 2.44% |
| 公益事業 | 2.42% |
| 合計 | 71.07% |

(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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 株式 | 1,863,359,429 | 97.43 |
| 内 ノルウェー | 39,542,056 | 2.07 |
| 内 スウェーデン | 149,995,531 | 7.84 |
| 内 イギリス | 675,274,982 | 35.31 |
| 内 オランダ | 111,463,582 | 5.83 |
| 内 フランス | 288,011,955 | 15.06 |
| 内 ドイツ | 262,443,328 | 13.72 |
| 内 スイス | 249,649,097 | 13.05 |
| 内 スペイン | 24,774,784 | 1.30 |
| 内 イタリア | 24,115,619 | 1.26 |
| 内 オーストリア | 38,088,495 | 1.99 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 49,203,530 | 2.57 |
| 純資産総額 | 1,912,562,959 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|------------|-----------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 5,831,739 | 0.30 |
| 内 日本 | 5,831,739 | 0.30 |
| 為替予約取引（売建） | 5,820,877 | 0.30 |
| 内 日本 | 5,820,877 | 0.30 |

(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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、 口数 または 額 面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------------------------------|------------|----|----------------|------------------------------|------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | NESTLE SA-REG | スイス | 株式 | 生活必需品 | 17,843 | 5,426.88 96,831,980 | 5,400.33 96,358,088 | 5.04 |
| 2 | HSBC HOLDINGS PLC | イギリス | 株式 | 金融 | 107,455 | 784.24 84,271,393 | 832.06 89,410,065 | 4.67 |
| 3 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A | イギリス | 株式 | エネルギー | 31,098 | 2,820.55 87,713,570 | 2,750.07 85,521,755 | 4.47 |
| 4 | SANOFI | フランス | 株式 | ヘルスケア | 9,695 | 7,068.52 68,529,369 | 7,402.02 71,762,666 | 3.75 |
| 5 | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | イギリス | 株式 | 生活必需品 | 15,195 | 4,231.48 64,297,472 | 4,325.02 65,718,743 | 3.44 |
| 6 | VODAFONE GROUP PLC | イギリス | 株式 | 電気通信 サービス | 306,222 | 230.28 70,517,269 | 211.17 64,667,722 | 3.38 |
| 7 | BNP PARIBAS | フランス | 株式 | 金融 | 13,271 | 4,096.84 54,369,263 | 4,563.53 60,562,693 | 3.17 |
| 8 | BASF SE | ドイツ | 株式 | 素材 | 8,266 | 6,859.68 56,702,189 | 7,326.37 60,559,841 | 3.17 |
| 9 | GLAXOSMITHKLINE PLC | イギリス | 株式 | ヘルスケア | 32,840 | 1,875.97 61,607,104 | 1,779.80 58,448,875 | 3.06 |
| 10 | ALLIANZ SE-REG | ドイツ | 株式 | 金融 | 5,128 | 9,805.79 50,284,124 | 10,633.69 54,529,562 | 2.85 |
| 11 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | ドイツ | 株式 | 一般消費財 ・サービス | 7,338 | 6,435.62 47,224,580 | 7,235.81 53,096,377 | 2.78 |
| 12 | BAYER AG | ドイツ | 株式 | ヘルスケア | 6,823 | 7,242.20 49,413,554 | 7,462.76 50,918,425 | 2.66 |
| 13 | TOTAL SA | フランス | 株式 | エネルギー | 12,161 | 4,063.28 49,413,600 | 4,109.10 49,970,774 | 2.61 |
| 14 | NOVARTIS AG-REG | スイス | 株式 | ヘルスケア | 9,721 | 5,103.75 49,613,597 | 5,103.75 49,613,597 | 2.59 |
| 15 | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | スウェー デン | 株式 | 生活必需品 | 29,751 | 1,451.29 43,177,507 | 1,653.34 49,188,637 | 2.57 |
| 16 | SCHNEIDER ELECTRIC SA | フランス | 株式 | 資本財・ サービス | 8,304 | 5,060.05 42,018,734 | 5,684.44 47,203,611 | 2.47 |
| 17 | NATIONAL GRID PLC | イギリス | 株式 | 公益事業 | 50,572 | 910.32 46,036,875 | 930.08 47,036,228 | 2.46 |
| 18 | PRUDENTIAL PLC | イギリス | 株式 | 金融 | 37,562 | 1,117.81 41,987,326 | 1,187.63 44,609,987 | 2.33 |
| 19 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | イギリス | 株式 | 生活必需品 | 8,303 | 4,755.81 39,487,524 | 5,177.38 42,987,803 | 2.25 |
| 20 | KON PHILIPS ELECTRONICS NV | オランダ | 株式 | 資本財・ サービス | 19,740 | 1,993.55 39,352,687 | 2,127.80 42,002,841 | 2.20 |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------|--------|----|------------|--------|-------------------------|-------------------------|------|
| 21 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | スイス | 株式 | 金融 | 1,980 | 21,176.37 41,929,224 | 20,937.34 41,455,943 | 2.17 |
| 22 | ATLAS COPCO AB-B SHS | スウェーデン | 株式 | 資本財・サービス | 21,562 | 1,690.30 36,446,335 | 1,880.03 40,537,250 | 2.12 |
| 23 | DNB ASA | ノルウェー | 株式 | 金融 | 39,401 | 1,049.06 41,334,249 | 1,003.58 39,542,056 | 2.07 |
| 24 | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | スウェーデン | 株式 | 一般消費財・サービス | 14,788 | 2,823.74 41,757,526 | 2,642.64 39,079,360 | 2.04 |
| 25 | GDF SUEZ | フランス | 株式 | 公益事業 | 21,009 | 1,845.97 38,782,167 | 1,852.37 38,916,478 | 2.03 |
| 26 | OESTERREICHISCHE POST AG | オーストリア | 株式 | 資本財・サービス | 11,485 | 3,036.67 34,876,212 | 3,316.36 38,088,495 | 1.99 |
| 27 | REXAM PLC | イギリス | 株式 | 素材 | 64,829 | 590.45 38,278,846 | 579.26 37,552,897 | 1.96 |
| 28 | BP PLC | イギリス | 株式 | エネルギー | 64,382 | 568.32 36,589,988 | 567.79 36,556,061 | 1.91 |
| 29 | KINGFISHER PLC | イギリス | 株式 | 一般消費財・サービス | 96,692 | 353.72 34,202,078 | 367.55 35,539,589 | 1.86 |
| 30 | KONINKLIJKE AHOLD NV | オランダ | 株式 | 生活必需品 | 33,866 | 1,021.28 34,586,729 | 1,040.24 35,229,026 | 1.84 |

(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 | 97.43% |
| 合計 | 97.43% |

(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 | 10.29% |
| 素材 | 11.14% |
| 資本財・サービス | 12.76% |
| 一般消費財・サービス | 8.12% |
| 生活必需品 | 15.14% |
| ヘルスケア | 12.06% |
| 金融 | 17.26% |
| 電気通信サービス | 5.67% |
| 公益事業 | 4.98% |
| その他 | 0.01% |
| 合計 | 97.43% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|------------------------------|-----------|---------|-----------|-----------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | ユーロ買/円売 2012年12月 | 買建 | 54,738 | 5,817,070 | 5,831,739 | 0.30% |
| | | 英ポンド売/円買 2012年12月 | 売建 | 21,601 | 2,836,806 | 2,845,447 | 0.15% |
| | | スウェーデン・クローネ 売/円買 2012年12月 | 売建 | 241,708 | 2,980,264 | 2,975,430 | 0.16% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------|---------------|---------|
| 株式 | | 1,747,832,347 | 94.47 |
| | 内 韓国 | 403,037,500 | 21.78 |
| | 内 中国 | 36,597,560 | 1.98 |
| | 内 台湾 | 321,727,453 | 17.39 |
| | 内 香港 | 126,709,220 | 6.85 |
| | 内 シンガポール | 143,826,830 | 7.77 |
| | 内 オーストラリア | 715,933,784 | 38.70 |
| 投資証券 | | 24,766,400 | 1.34 |
| | 内 シンガポール | 24,766,400 | 1.34 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 77,595,665 | 4.19 |
| 純資産総額 | | 1,850,194,412 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、 口数 または 額 面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|---|------------------------------|---------|----|------|------------------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------|
| 1 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国 | 株式 | 情報技術 | 1,300 | 98,496.00 128,044,800 | 107,464.00 139,703,200 | 7.55 |
| 2 | COMMONWEALTH BANK | オーストラリア | 株式 | 金融 | 21,000 | 4,870.33 102,277,130 | 5,092.22 106,936,721 | 5.78 |
| 3 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | オーストラリア | 株式 | 金融 | 44,000 | 2,198.29 96,724,857 | 2,063.79 90,806,773 | 4.91 |
| 4 | BHP BILLITON LTD | オーストラリア | 株式 | 素材 | 27,000 | 2,873.37 77,581,039 | 2,930.77 79,130,809 | 4.28 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|---------|------|------------|---------|-------------------------|-------------------------|------|
| 5 | TSMC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 250,000 | 243.36 60,841,500 | 272.13 68,032,500 | 3.68 |
| 6 | WESTPAC BANKING CORP | オーストラリア | 株式 | 金融 | 30,000 | 2,201.71 66,051,570 | 2,161.45 64,843,623 | 3.50 |
| 7 | WESFARMERS LTD | オーストラリア | 株式 | 生活必需品 | 17,000 | 2,971.89 50,522,169 | 3,057.56 51,978,559 | 2.81 |
| 8 | TELSTRA CORP LTD | オーストラリア | 株式 | 電気通信サービス | 133,734 | 336.68 45,025,978 | 369.23 49,379,635 | 2.67 |
| 9 | OSIM INTERNATIONAL LTD | シンガポール | 株式 | 一般消費財・サービス | 400,000 | 96.23 38,495,600 | 118.44 47,379,200 | 2.56 |
| 10 | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 台湾 | 株式 | 電気通信サービス | 220,000 | 209.24 46,033,680 | 203.04 44,668,800 | 2.41 |
| 11 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS | 香港 | 株式 | 情報技術 | 130,000 | 298.92 38,859,600 | 307.40 39,962,000 | 2.16 |
| 12 | ORICA LTD | オーストラリア | 株式 | 素材 | 18,500 | 2,188.86 40,494,067 | 2,034.66 37,641,256 | 2.03 |
| 13 | S-OIL CORPORATION | 韓国 | 株式 | エネルギー | 5,000 | 7,504.36 37,521,806 | 7,387.20 36,936,000 | 2.00 |
| 14 | KB FINANCIAL GROUP INC | 韓国 | 株式 | 金融 | 13,500 | 2,850.00 38,475,000 | 2,686.60 36,269,100 | 1.96 |
| 15 | SUNCORP GROUP LTD | オーストラリア | 株式 | 金融 | 44,000 | 815.57 35,885,450 | 824.14 36,262,398 | 1.96 |
| 16 | CSL LTD | オーストラリア | 株式 | ヘルスケア | 8,000 | 3,977.65 31,821,265 | 4,433.42 35,467,380 | 1.92 |
| 17 | LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 韓国 | 株式 | 生活必需品 | 650 | 50,388.00 32,752,200 | 50,312.00 32,702,800 | 1.77 |
| 18 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | シンガポール | 株式 | 金融 | 25,000 | 1,278.70 31,967,500 | 1,257.83 31,445,925 | 1.70 |
| 19 | RADIANT OPTO-ELECTRONICS | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 72,100 | 362.37 26,126,877 | 366.60 26,431,860 | 1.43 |
| 20 | NEWCREST MINING LTD | オーストラリア | 株式 | 素材 | 12,000 | 2,353.78 28,246,311 | 2,194.00 26,328,104 | 1.42 |
| 21 | HYUNDAI MOTOR CO | 韓国 | 株式 | 一般消費財・サービス | 1,500 | 17,366.00 26,049,000 | 17,518.00 26,277,000 | 1.42 |
| 22 | TPK HOLDING CO LTD | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 20,183 | 1,062.80 21,450,626 | 1,292.97 26,096,014 | 1.41 |
| 23 | CAPITACOMMERCIAL TRUST | シンガポール | 投資証券 | - | 230,000 | 100.95 23,218,500 | 107.68 24,766,400 | 1.34 |
| 24 | TRANSURBAN GROUP | オーストラリア | 株式 | 資本財・サービス | 45,000 | 520.01 23,400,761 | 531.15 23,901,930 | 1.29 |
| 25 | M1 LTD | シンガポール | 株式 | 電気通信サービス | 130,000 | 178.34 23,184,850 | 182.38 23,709,790 | 1.28 |
| 26 | WOODSIDE PETROLEUM LTD | オーストラリア | 株式 | エネルギー | 8,000 | 2,930.77 23,446,166 | 2,878.51 23,028,096 | 1.24 |
| 27 | WINS TECHNET CO LTD | 韓国 | 株式 | 情報技術 | 21,000 | 1,009.22 21,193,647 | 1,029.80 21,625,800 | 1.17 |
| 28 | HANG SENG BANK LTD | 香港 | 株式 | 金融 | 17,000 | 1,255.04 21,335,680 | 1,251.86 21,281,620 | 1.15 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------|--------|----|------------|---------|----------------------|----------------------|------|
| 29 | MSTAR SEMICONDUCTOR INC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 30,000 | 686.67 20,600,100 | 697.95 20,938,500 | 1.13 |
| 30 | COURTS ASIA LTD | シンガポール | 株式 | 一般消費財・サービス | 400,000 | 51.21 20,494,319 | 51.48 20,593,800 | 1.11 |

(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 | 94.47% |
| 投資証券 | 1.34% |
| 合計 | 95.81% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種 | 投資比率 |
|------------|--------|
| エネルギー | 3.24% |
| 素材 | 14.19% |
| 資本財・サービス | 4.88% |
| 一般消費財・サービス | 6.76% |
| 生活必需品 | 5.50% |
| ヘルスケア | 1.92% |
| 金融 | 28.86% |
| 情報技術 | 22.11% |
| 電気通信サービス | 7.00% |
| 合計 | 94.47% |

(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11月30日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 株式 | 22,150,742,130 | 97.90 |
| 内 日本 | 22,150,742,130 | 97.90 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 474,692,814 | 2.10 |
| 純資産総額 | 22,625,434,944 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、 口数 または 額 面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|---------------|----|----|---------|------------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 272,000 | 2,392.34 650,718,885 | 2,654.00 721,888,000 | 3.19 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 1,598,000 | 357.00 570,486,000 | 377.00 602,446,000 | 2.66 |
| 3 | UKCホールディングス | 日本 | 株式 | 卸売業 | 306,400 | 1,427.00 437,232,800 | 1,643.00 503,415,200 | 2.22 |
| 4 | 日本デジタル研究所 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 396,700 | 817.00 324,103,900 | 865.00 343,145,500 | 1.52 |
| 5 | シンニッタン | 日本 | 株式 | 鉄鋼 | 1,019,500 | 311.00 317,064,500 | 325.00 331,337,500 | 1.46 |
| 6 | S C S K | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 24,000 | 1,357.38 304,053,408 | 1,409.00 315,616,000 | 1.39 |
| 7 | NECネットエスアイ | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 208,600 | 1,390.99 290,160,599 | 1,475.00 307,685,000 | 1.36 |
| 8 | K D D I | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 48,800 | 5,823.18 284,171,904 | 6,100.00 297,680,000 | 1.32 |
| 9 | 藤森工業 | 日本 | 株式 | 化学 | 123,100 | 1,728.00 212,716,800 | 2,233.00 274,882,300 | 1.21 |
| 10 | M C J | 日本 | 株式 | 電気機器 | 1,693,000 | 150.00 253,950,000 | 158.00 267,494,000 | 1.18 |
| 11 | エイベックス・グループHD | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 49,000 | 1,480.97 220,664,800 | 1,775.00 264,475,000 | 1.17 |
| 12 | キョーリン製薬HD | 日本 | 株式 | 医薬品 | 150,000 | 1,726.62 258,994,461 | 1,754.00 263,100,000 | 1.16 |
| 13 | 遠藤照明 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 81,100 | 3,538.67 286,986,723 | 3,165.00 256,681,500 | 1.13 |
| 14 | 日産自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 320,000 | 757.35 242,352,786 | 799.00 255,680,000 | 1.13 |
| 15 | ディー・エヌ・エー | 日本 | 株式 | サービス業 | 83,000 | 2,520.35 209,189,219 | 3,025.00 251,075,000 | 1.11 |
| 16 | 牧野フライス | 日本 | 株式 | 機械 | 558,000 | 414.24 231,147,565 | 439.00 244,962,000 | 1.08 |
| 17 | 愛知電機 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 947,000 | 275.00 260,425,000 | 245.00 232,015,000 | 1.03 |
| 18 | 東燃ゼネラル石油 | 日本 | 株式 | 石油・石炭製品 | 301,000 | 708.00 213,108,000 | 765.00 230,265,000 | 1.02 |
| 19 | 富士紡ホールディングス | 日本 | 株式 | 繊維製品 | 694,000 | 358.36 248,703,736 | 314.00 217,916,000 | 0.96 |
| 20 | ワキタ | 日本 | 株式 | 卸売業 | 350,000 | 536.00 187,600,000 | 613.00 214,550,000 | 0.95 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------|----|----|--------|---------|---------------------------|---------------------------|------|
| 21 | セブテーニHLDGS | 日本 | 株式 | サービス業 | 3,230 | 72,600.00 234,498,000 | 66,100.00 213,503,000 | 0.94 |
| 22 | 富士重工業 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 224,000 | 733.28 164,256,599 | 925.00 207,200,000 | 0.92 |
| 23 | 日立機材 | 日本 | 株式 | 金属製品 | 374,400 | 483.00 180,835,200 | 540.00 202,176,000 | 0.89 |
| 24 | フロイント産業 | 日本 | 株式 | 機械 | 154,000 | 948.00 145,992,000 | 1,288.00 198,352,000 | 0.88 |
| 25 | N O K | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 156,000 | 1,173.19 183,018,000 | 1,261.00 196,716,000 | 0.87 |
| 26 | 大分銀行 | 日本 | 株式 | 銀行業 | 680,000 | 243.00 165,240,000 | 288.00 195,840,000 | 0.87 |
| 27 | NECキャピタルソリューション | 日本 | 株式 | その他金融業 | 70,000 | 1,065.00 181,050,000 | 1,148.00 195,160,000 | 0.86 |
| 28 | ワコム | 日本 | 株式 | 電気機器 | 826 | 230,324.57 190,248,102 | 235,000.00 194,110,000 | 0.86 |
| 29 | キヤノン | 日本 | 株式 | 電気機器 | 66,000 | 2,545.90 168,029,457 | 2,883.00 190,278,000 | 0.84 |
| 30 | T B K | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 444,000 | 363.00 161,172,000 | 416.00 184,704,000 | 0.82 |

(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 | 97.90% |
| 合計 | 97.90% |

(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 | 2.94% |
| 食料品 | 0.97% |
| 繊維製品 | 2.29% |
| 化学 | 3.82% |
| 医薬品 | 4.08% |
| 石油・石炭製品 | 1.11% |
| ゴム製品 | 1.25% |
| ガラス・土石製品 | 1.71% |
| 鉄鋼 | 3.70% |
| 非鉄金属 | 1.00% |
| 金属製品 | 4.76% |
| 機械 | 6.25% |
| 電気機器 | 11.32% |
| 輸送用機器 | 8.72% |
| その他製品 | 3.47% |
| 電気・ガス業 | 0.40% |
| 陸運業 | 1.89% |
| 海運業 | 0.85% |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.62% |

| | |
|------------|--------|
| 情報・通信業 | 10.75% |
| 卸売業 | 6.50% |
| 小売業 | 0.87% |
| 銀行業 | 8.06% |
| 証券、商品先物取引業 | 0.42% |
| 保険業 | 0.90% |
| その他金融業 | 0.89% |
| 不動産業 | 2.78% |
| サービス業 | 5.59% |
| 合計 | 97.90% |

(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11月30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 | 2,271,973,634 | 99.35 |
| 内 日本 | 2,271,973,634 | 99.35 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 14,979,407 | 0.65 |
| 純資産総額 | 2,286,953,041 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 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 | 1,256,688,766 1,526,751,187 | 1.2149 | 1.2702 1,596,246,070 | 69.80 |
| 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 | 211,483,635 213,767,668 | 1.0108 | 1.0732 226,964,237 | 9.92 |
| 3 | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 105,724,396 105,386,078 | 0.9968 | 1.0460 110,587,718 | 4.84 |
| 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 | 95,921,597 105,657,639 | 1.1015 | 1.1466 109,983,703 | 4.81 |

| | | | | | | | |
|---|--------------------------|----|-----------|------------|----------------------|----------------------|------|
| 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 | 63,201,014 | 1.2329 77,920,531 | 1.3079 82,660,606 | 3.61 |
| 6 | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 84,384,340 | 0.8124 68,562,276 | 0.8703 73,439,691 | 3.21 |
| 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 | 71,661,640 | 0.9577 68,630,352 | 1.0060 72,091,609 | 3.15 |

(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 | 99.35% |
| 合計 | 99.35% |

(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 |
| 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 |
| 平成23年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 | - |
| 6月末日 | 2,392,602,013 | - | 0.6384 | - |
| 7月末日 | 2,350,623,497 | - | 0.6372 | - |
| 8月末日 | 2,333,959,924 | - | 0.6443 | - |
| 9月末日 | 2,292,276,080 | - | 0.6465 | - |
| 10月末日 | 2,264,480,165 | - | 0.6592 | - |
| 第14特定期間末 (平成24年11月12日) | 2,219,108,902 | 2,236,164,141 | 0.6506 | 0.6556 |
| 11月末日 | 2,286,953,041 | - | 0.6815 | - |

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 |
| 第14特定期間 | 0.0150 |

(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 |
| 第14特定期間 | 2.5 |

(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 |
| 第14特定期間 | 14,620,571 | 663,919,130 |

(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11月30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 | 8,489,352,714 | 99.40 |
| 内 日本 | 8,489,352,714 | 99.40 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 51,326,543 | 0.60 |
| 純資産総額 | 8,540,679,257 | 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11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 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 | 2,779,925,118 2,809,948,359 | 1.0108 | 1.0732 2,983,415,636 | 34.93 |
| 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 | 1,327,534,177 1,612,821,276 | 1.2149 | 1.2702 1,686,233,911 | 19.74 |
| 3 | 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 | 785,601,842 968,568,531 | 1.2329 | 1.3079 1,027,488,649 | 12.03 |
| 4 | 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 | 1,143,675,661 929,236,476 | 0.8125 | 0.8703 995,340,927 | 11.65 |
| 5 | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 970,849,511 929,782,577 | 0.9577 | 1.0060 976,674,608 | 11.44 |
| 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 | 357,756,210 394,068,465 | 1.1015 | 1.1466 410,203,270 | 4.80 |
| 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 | 391,965,309 390,711,020 | 0.9967 | 1.0460 409,995,713 | 4.80 |

(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 | 99.40% |
| 合計 | 99.40% |

(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 |
| 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 |
| 平成23年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 | - |
| 6月末日 | 8,784,899,878 | - | 0.5754 | - |
| 7月末日 | 8,619,918,505 | - | 0.5722 | - |
| 8月末日 | 8,514,731,269 | - | 0.5762 | - |
| 9月末日 | 8,475,594,921 | - | 0.5846 | - |
| 10月末日 | 8,427,385,021 | - | 0.5932 | - |
| 第14特定期間末 (平成24年11月12日) | 8,222,189,610 | 8,278,659,413 | 0.5824 | 0.5864 |
| 11月末日 | 8,540,679,257 | - | 0.6147 | - |

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 |
| 第14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 |
| 第14特定期間 | 0.4 |

(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 |
| 第14特定期間 | 53,311,081 | 1,567,032,356 |

(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11月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

| | |
|-------|--------|
| 基準価額 | 7,752円 |
| 純資産総額 | 23億円 |

| 基準価額の騰落率 | |
|----------|-------|
| 期間 | ファンド |
| 1カ月間 | 2.7% |
| 3カ月間 | 5.1% |
| 6カ月間 | 7.8% |
| 1年間 | 12.0% |
| 3年間 | 11.6% |
| 5年間 | -5.9% |
| 設定来 | 6.7% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。基準価額の計算において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: 2,770円

| 決算期 | 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 | 第40期 | 第41期 | 第42期 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | 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 | 12年7月 | 12年9月 | 12年11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。

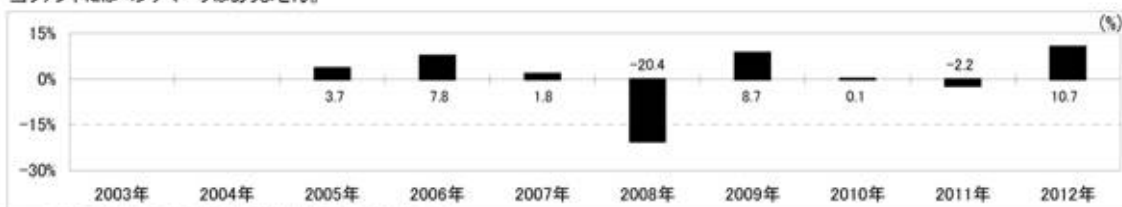
| 資産別構成 | | | 通貨別構成 | | | 債券ポートフォリオ特性値 | | | 組入上位銘柄 | | | | | |
|-------------|------|--------|-------|--------|-------------|--------------|----------|-----------|--------|---------|-------|----------------------------|---------|------|
| 銘柄数 | 比率 | | 銘柄数 | 比率 | | 直接利回り(%) | 最終利回り(%) | 修正デュレーション | 残存年数 | 債券格付別構成 | 比率 | 組入上位銘柄 | 国・地域名 | 比率 |
| 外国債券 | 35 | 34.2% | 日本円 | 50.1% | 直接利回り(%) | 3.8 | | | | AAA | 42.8% | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 0.3% |
| 国内債券 | 45 | 34.1% | 米ドル | 13.4% | 最終利回り(%) | 1.3 | | | | AA | 53.3% | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国 | 0.3% |
| 国内株式 | 200 | 9.8% | ユーロ | 11.0% | 修正デュレーション | 7.3 | | | | A | 3.9% | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 0.3% |
| 外国株式 | 194 | 8.9% | 豪ドル | 7.3% | 残存年数 | 9.2 | | | | BBB | - | UKCホールディングス | 日本 | 0.2% |
| 外国リート等 | 150 | 5.6% | カナダドル | 5.4% | 債券格付別構成 | | | | | BB | - | COMMONWEALTH BANK | オーストラリア | 0.2% |
| 国内リート | 29 | 4.7% | 英ポンド | 5.3% | ポーランド・ズロチ | 2.7% | | | | | | 日本ビルファンド | 日本 | 0.7% |
| | | | | | スウェーデン・クローネ | 0.9% | | | | | | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 0.6% |
| | | | | | 韓国ウォン | 0.8% | | | | | | 森トラスト総合リート | 日本 | 0.3% |
| | | | | | その他 | 3.1% | | | | | | 日本リテールファンド | 日本 | 0.3% |
| コール・ローン、その他 | 2.7% | | | | | | | | | | | WESTFIELD GROUP | オーストラリア | 0.3% |
| 合計 | 653 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 100.0% | | | | | | 合計 | | 3.4% |

※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11月30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11月30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 | 6,815円 |
| 純資産総額 | 22億円 |

| 基準価額の騰落率 | |
|----------|--------|
| 期間 | ファンド |
| 1か月間 | 4.2% |
| 3か月間 | 7.4% |
| 6か月間 | 11.2% |
| 1年間 | 16.1% |
| 3年間 | 12.9% |
| 5年間 | -11.1% |
| 設定来 | 6.4% |



※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: 350円 設定来分配金合計額: 3,655円

| 決算期 | 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 | 第40期 | 第41期 | 第42期 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | 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 | 12年7月 | 12年9月 | 12年11月 |
| 分配金 | 100円 | 100円 | 100円 | 75円 | 75円 | 75円 | 75円 | 75円 | 50円 | 50円 | 50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。

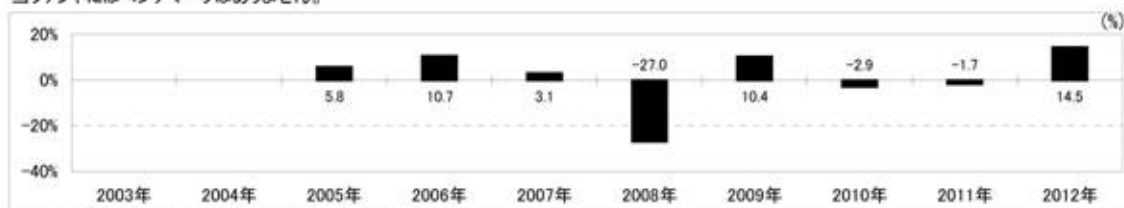
| 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | 通貨別構成 | 比率 | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄 | 国・地域名 | 比率 |
|-------------|------|--------|-------------|--------|--------------|----------------------------|---------|------|
| 外国債券 | 35 | 68.2% | 米ドル | 21.4% | 直接利回り(%) | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 0.3% |
| 国内株式 | 200 | 9.7% | ユーロ | 20.1% | 最終利回り(%) | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国 | 0.3% |
| 外国株式 | 194 | 8.8% | 日本円 | 15.5% | 修正デュレーション | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 0.3% |
| 外国リート等 | 150 | 5.5% | 豪ドル | 12.1% | 残存年数 | UKCホールディングス | 日本 | 0.2% |
| 国内リート | 29 | 4.7% | カナダドル | 10.4% | 債券格付別構成 | COMMONWEALTH BANK | オーストラリア | 0.2% |
| | | | 英ポンド | 8.9% | AAA | 日本ビルファンド | 日本 | 0.7% |
| | | | ポーランド・ズロチ | 5.3% | AA | 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 | 1.5% | A | 森トラスト総合リート | 日本 | 0.3% |
| | | | デンマーク・クローネ | 0.8% | BBB | 日本リテールファンド | 日本 | 0.3% |
| コール・ローン、その他 | 3.1% | その他 | 3.8% | BB | - | WESTFIELD GROUP | オーストラリア | 0.3% |
| 合計 | 608 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 合計 | | 3.4% |

※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11月30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11月30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 | 6,147円 |
| 純資産総額 | 85億円 |

| 基準価額の騰落率 | |
|----------|--------|
| 期間 | ファンド |
| 1カ月間 | 4.3% |
| 3カ月間 | 8.2% |
| 6カ月間 | 12.5% |
| 1年間 | 18.2% |
| 3年間 | 14.5% |
| 5年間 | -24.7% |
| 設定来 | -6.2% |



※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: 3,730円

| 決算期 | 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 | 第40期 | 第41期 | 第42期 |
|-----|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | 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 | 12年7月 | 12年9月 | 12年11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。

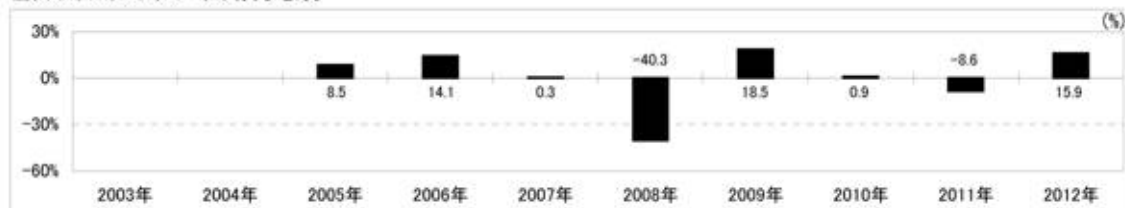
| 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | 通貨別構成 | 比率 | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄 | 国・地域名 | 比率 | |
|-------------|-----|--------|---------|--------|--------------|----------------------------|-----------------|---------|------|
| 国内株式 | 200 | 34.2% | 日本円 | 40.7% | 直接利回り(%) | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 1.1% | |
| 外国株式 | 194 | 30.8% | 米ドル | 17.4% | 最終利回り(%) | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 0.9% | |
| 外国債券 | 35 | 19.3% | ユーロ | 10.4% | 修正デュレーション | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国 | 0.9% | |
| 外国リート等 | 150 | 7.6% | 豪ドル | 8.4% | 残存年数 | UKCホールディングス | 日本 | 0.8% | |
| 国内リート | 29 | 4.6% | 英ポンド | 6.7% | 債券格付別構成 比率 | COMMONWEALTH BANK | オーストラリア | 0.7% | |
| | | | カナダドル | 3.7% | AAA | 85.5% | 日本ビルファンド | 日本 | 0.7% |
| | | | 韓国ウォン | 2.7% | AA | 6.7% | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 0.6% |
| | | | 台湾ドル | 2.1% | A | 7.8% | 森トラスト総合リート | 日本 | 0.3% |
| | | | スイス・フラン | 1.5% | BBB | - | 日本リテールファンド | 日本 | 0.3% |
| コール・ローン、その他 | | 3.4% | その他 | 6.3% | BB | - | WESTFIELD GROUP | オーストラリア | 0.3% |
| 合計 | 608 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | 6.5% | |

※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11月30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2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行いません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行いません。

2 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

< 一部解約 >

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン国際金融先物取引所（L I F F E）のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の株式およびハイブリッド優先証券：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・海外の店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、および11月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、平成17年11月14日から平成18年1月10日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、前4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

運用報告書

委託会社は、毎年5月および11月の計算期末に、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として

毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとしします。

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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24年5月11日から平成24年11月12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）】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

| | 前 期 平成24年5月10日現在 | 当 期 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 23,815,791 | 20,886,573 |
| 親投資信託受益証券 | 2,543,320,733 | 2,275,918,836 |
| 未収入金 | 23,000,000 | 28,500,000 |
| 流動資産合計 | 2,590,136,524 | 2,325,305,409 |
| 資産合計 | | |
| | 2,590,136,524 | 2,325,305,409 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 23,641,775 | 21,362,096 |
| 未払解約金 | - | 6,264,334 |
| 未払受託者報酬 | 225,912 | 213,905 |
| 未払委託者報酬 | 5,196,229 | 4,920,087 |
| その他未払費用 | 105,432 | 97,200 |
| 流動負債合計 | 29,169,348 | 32,857,622 |
| 負債合計 | | |
| | 29,169,348 | 32,857,622 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ₁ 3,377,396,462 | ₁ 3,051,728,057 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | ₂ 816,429,286 | ₂ 759,280,270 |
| （分配準備積立金） | 96,310,527 | 79,591,973 |
| 元本等合計 | 2,560,967,176 | 2,292,447,787 |
| 純資産合計 | 2,560,967,176 | 2,292,447,787 |
| 負債純資産合計 | 2,590,136,524 | 2,325,305,409 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 前 期 自 平成23年11月11日 至 平成24年5月10日 | 当 期 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12日 |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 10,327 | 9,451 |
| 有価証券売買等損益 | 141,751,905 | 58,598,103 |
| 営業収益合計 | 141,762,232 | 58,607,554 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 703,495 | 648,561 |
| 委託者報酬 | ¹ 16,181,291 | ¹ 14,917,783 |
| その他費用 | 105,432 | 97,200 |
| 営業費用合計 | 16,990,218 | 15,663,544 |
| 営業利益 | 124,772,014 | 42,944,010 |
| 経常利益 | 124,772,014 | 42,944,010 |
| 当期純利益 | 124,772,014 | 42,944,010 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 3,611,372 | 344,810 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 966,219,181 | 816,429,286 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 108,219,864 | 85,533,383 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 108,219,864 | 85,533,383 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,164,673 | 4,453,294 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,164,673 | 4,453,294 |
| 分配金 | ² 73,425,938 | ² 66,530,273 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 816,429,286 | 759,280,270 |

(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24年5月11日 至平成24年11月12日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日 平成24年11月10日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成24年11月12日としております。このため、当特定期間は186日となっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前期 平成24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額 | 3,776,327,573円 | 3,377,396,462円 |
| 期中追加設定元本額 | 25,669,129円 | 17,944,954円 |
| 期中一部解約元本額 | 424,600,240円 | 343,613,359円 |
| 2. 特定期間末日における受益権の総数 | 3,377,396,462口 | 3,051,728,057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816,429,286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759,280,270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11月11日 至平成24年5月10日 | 当期 自平成24年5月11日 至平成24年11月12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 | 680,034円 | 644,362円 |

2. 2 分配金の計算過程

（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。

（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。

（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。

（自平成24年5月11日 至平成24年7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（9,832,177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（25,448,530円）及び分配準備積立金（93,347,681円）より分配対象額は128,628,388円（1万口当たり392.19円）であり、うち22,958,394円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

（自平成24年7月11日 至平成24年9月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,470,757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（13,658,460円）及び分配準備積立金（88,569,702円）より分配対象額は113,698,919円（1万口当たり358.35円）であり、うち22,209,783円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

（自平成24年9月11日 至平成24年11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（13,143,031円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,632,489円）及び分配準備積立金（85,369,656円）より分配対象額は101,145,176円（1万口当たり331.44円）であり、うち21,362,096円（1万口当たり70円）を分配金額としております。

（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 | 当期 |
|----------------------------|---|
| | 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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 | 当期 |
|-----------|------------------------|------------------------|
| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 42,071,003 | 35,311,004 |
| 合計 | 42,071,003 | 35,311,004 |

（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 | 当期 |
|--------------|---------------|
| 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.7583円 (7,583円) | 0.7512円 (7,512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 | 660,041,621 | 801,884,565 | |
| | ダイワ日本国債マザーファンド | 696,577,749 | 808,030,188 | |
| | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 110,373,918 | 110,020,721 | |
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド | 220,039,939 | 222,416,370 | |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 74,240,185 | 71,099,825 | |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 89,170,342 | 72,450,902 | |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 65,009,455 | 80,150,157 | |
| | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 99,742,268 | 109,866,108 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 2,275,918,836 | |
| 合計 | | | 2,275,918,836 | |

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

[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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|------------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 256,374,889 | 419,094,571 |
| コール・ローン | 39,849,652 | 91,804,552 |
| 国債証券 | 71,939,084,142 | 64,236,798,754 |
| 特殊債券 | 9,433,459,732 | 6,503,683,355 |
| 派生商品評価勘定 | 15,495,385 | 2,045,980 |
| 未収入金 | 8,876,787,492 | 913,421,612 |
| 未収利息 | 1,203,709,450 | 948,350,905 |
| 前払費用 | 606,292,366 | 318,494,426 |
| 流動資産合計 | 92,371,053,108 | 73,433,694,155 |
| 資産合計 | 92,371,053,108 | 73,433,694,155 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 3,128,263 | 286,500 |
| 未払金 | 8,015,974,167 | 400,930,676 |
| 未払解約金 | 132,150,000 | 503,500,000 |
| 流動負債合計 | 8,151,252,430 | 904,717,176 |
| 負債合計 | 8,151,252,430 | 904,717,176 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 71,749,438,708 | 59,697,533,342 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 12,470,361,970 | 12,831,443,637 |
| 元本等合計 | 84,219,800,678 | 72,528,976,979 |
| 純資産合計 | 84,219,800,678 | 72,528,976,979 |
| 負債純資産合計 | 92,371,053,108 | 73,433,694,155 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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 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、原則として期末日の対顧客先物売買取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. 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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|--------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 92,520,635,939円 | 71,749,438,708円 |
| 期中追加設定元本額 | 44,804,174円 | 1,729,643円 |
| 期中一部解約元本額 | 20,816,001,405円 | 12,053,635,009円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用） | 7,784,361,116円 | 6,503,716,815円 |
| 富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型） | 1,763,547,120円 | 1,479,794,603円 |
| 北海道応援・外債バランスファンド（毎月分配型） | 2,321,330,617円 | 2,052,876,802円 |
| 福島応援・外債バランスファンド（毎月分配型） | 881,534,669円 | 646,720,443円 |
| ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型） | 3,987,006,992円 | 3,159,800,825円 |
| ダイワ・バランス2資産（外債・好配当日本株）（毎月分配型） | 66,887,263円 | 58,612,535円 |
| ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株） | 85,785,200円 | 80,741,915円 |
| 新潟県応援ファンド（外債バランス・毎月分配型） | 1,097,712,752円 | 977,929,627円 |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 761,063,021円 | 660,041,621円 |
| インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 1,577,290,475円 | 1,282,718,754円 |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 1,585,912,227円 | 1,356,466,596円 |
| FITネット・三県応援ファンド（毎月分配型） | 856,619,888円 | 684,046,382円 |
| 長野応援ファンド（毎月分配型） | 686,959,386円 | 617,592,986円 |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形成型） | 13,908,088円 | - 円 |
| インカム重視ポートフォリオ（資産形成型） | 45,349,732円 | - 円 |
| 成長重視ポートフォリオ（資産形成型） | 35,954,851円 | - 円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| 栃木応援・外債バランスファンド(毎月分配型) | 942,413,989円 | 785,494,817円 |
| 京都応援バランスファンド(隔月分配型) | 672,174,504円 | 568,989,716円 |
| 北東北三県応援・外債バランスファンド(毎月分配型) | 882,512,203円 | 725,201,374円 |
| 6資産バランスファンド(分配型) | 3,494,224,216円 | 2,927,672,374円 |
| 6資産バランスファンド(成長型) | 265,906,998円 | 241,993,947円 |
| ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型) | 29,859,262,696円 | 24,528,099,785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) | 635,321,323円 | 547,602,272円 |
| 奈良応援ファンド(外債バランス・毎月分配型) | 234,447,456円 | 203,922,116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) | 690,419,277円 | 604,150,646円 |
| 世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型) | 343,854,531円 | 270,356,884円 |
| ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型) | 3,278,408,080円 | 2,831,726,782円 |
| 兵庫応援バランスファンド(毎月分配型) | 352,678,694円 | 269,615,818円 |
| 『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型) | 78,719,177円 | 67,253,120円 |
| ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド | 888,685,603円 | 797,853,349円 |
| 紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型) | 311,598,921円 | 271,906,322円 |
| 愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型) | 522,533,502円 | 371,663,384円 |
| ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) | 4,397,776,471円 | 3,845,808,240円 |
| 地球環境株・外債バランス・ファンド | 333,755,532円 | 271,498,637円 |
| ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型) | 13,522,138円 | 5,663,855円 |
| 計 | 71,749,438,708円 | 59,697,533,342円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 71,749,438,708口 | 59,697,533,342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24年5月11日 至 平成24年11月12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こと、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 787,069,951 | 470,839,674 |
| 特殊債券 | 346,753,148 | 50,630,706 |
| 合計 | 1,133,823,099 | 420,208,968 |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年4月11日から平成24年5月10日まで、及び平成24年10月11日から平成24年11月12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24年5月10日 現在 | | | | 平成24年11月12日 現在 | | | | | |
|-----------|---------------|-----|------|-----------|----------------|-------------|-----|------|-----------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち | | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち | | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| | | 1年超 | 1年以内 | | | | 1年超 | 1年以内 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | | | |

| 為替予約取引 | | | | | | | | |
|------------------------|----------------|---|----------------|------------|---------------|---|---------------|-----------|
| 売 建 | 6,301,898,452 | - | 6,293,011,580 | 8,886,872 | 1,034,182,450 | - | 1,032,136,470 | 2,045,980 |
| イギリス・ポ ンド | - | - | - | - | 85,067,200 | - | 85,060,470 | 6,730 |
| オーストラリ ア | 1,814,919,602 | - | 1,808,331,580 | 6,588,022 | - | - | - | - |
| ・ドル スウェーデン ・クローナ | 174,218,850 | - | 173,700,000 | 518,850 | - | - | - | - |
| チェコ・コ ルナ | - | - | - | - | 160,298,250 | - | 159,201,000 | 1,097,250 |
| デンマーク ・クローネ | - | - | - | - | 434,542,000 | - | 433,920,000 | 622,000 |
| ノルウェー ・クローネ | 2,146,190,000 | - | 2,144,620,000 | 1,570,000 | - | - | - | - |
| ユーロ | 2,166,570,000 | - | 2,166,360,000 | 210,000 | 354,275,000 | - | 353,955,000 | 320,000 |
| 買 建 | 5,741,032,000 | - | 5,744,512,250 | 3,480,250 | 477,767,200 | - | 477,480,700 | 286,500 |
| アメリカ・ド ル | - | - | - | - | 85,067,200 | - | 85,054,513 | 12,687 |
| イギリス・ポ ンド | 4,312,760,000 | - | 4,315,788,117 | 3,028,117 | - | - | - | - |
| オーストラリ ア | - | - | - | - | 392,700,000 | - | 392,426,187 | 273,813 |
| ・ドル カナダ・ドル | 1,428,272,000 | - | 1,428,724,133 | 452,133 | - | - | - | - |
| 合計 | 12,042,930,452 | - | 12,037,523,830 | 12,367,122 | 1,511,949,650 | - | 1,509,617,170 | 1,759,480 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1738円 | 1.2149円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,738円) | (12,149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 | 8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815 | アメリカ・ドル 8,000,000.000 | アメリカ・ドル 11,774,960.000 | |
| | | 8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515 | 22,700,000.000 | 35,312,574.000 | |
| | | 8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815 | 95,700,000.000 | 149,912,136.000 | |
| | | 7.625% U.S. TREASURY BOND 20221115 | 4,000,000.000 | 6,278,120.000 | |
| | | 7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215 | 1,500,000.000 | 2,460,810.000 | |
| | アメリカ・ドル 小計 | | アメリカ・ドル 205,738,600.000 (16,358,276,085) | | |
| イギリス・ポンド | | 8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607 | イギリス・ポンド 33,500,000.000 | イギリス・ポンド 51,512,950.000 | |
| | | 6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207 | 4,000,000.000 | 6,006,000.000 | |
| | | 4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207 | 4,800,000.000 | 6,176,160.000 | |
| | イギリス・ポンド 小計 | | イギリス・ポンド 63,695,110.000 (8,051,061,904) | | |
| オーストラリア・ドル | | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421 | オーストラリア・ドル 8,000,000.000 | オーストラリア・ドル 9,698,240.000 | |
| | | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 25,000,000.000 | 28,819,250.000 | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | | オーストラリア・ドル 38,517,490.000 (3,182,700,199) | | |
| カナダ・ドル | | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601 | カナダ・ドル 19,500,000.000 | カナダ・ドル 31,112,445.000 | |
| | | 9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601 | 37,600,000.000 | 67,245,344.000 | |
| | | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 12,800,000.000 | 22,321,664.000 | |
| | | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601 | 5,000,000.000 | 5,599,150.000 | |
| | カナダ・ドル 小計 | | カナダ・ドル 126,278,603.000 (10,037,886,153) | | |
| 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 100,000,000.000 | スウェーデン・クローナ 108,923,000.000 | |
| | スウェーデン・クローナ 小計 | | スウェーデン・クローナ 108,923,000.000 (1,285,291,400) | | |
| デンマーク・クローネ | | 7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110 | デンマーク・クローネ 24,000,000.000 | デンマーク・クローネ 39,224,400.000 | |
| | | 4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115 | 15,000,000.000 | 17,756,400.000 | |
| | デンマーク・クローネ 小計 | | デンマーク・クローネ 56,980,800.000 | | |

| | | | | |
|---------------|---|-----------------|---|---------------|
| | | | | (772,659,648) |
| ノルウェー・クローネ | | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |
| | 6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515 | 56,500,000.000 | 57,884,250.000 | |
| | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525 | 10,000,000.000 | 11,508,500.000 | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | | ノルウェー・クローネ 69,392,750.000 (961,783,516) | |
| ポーランド・ズロチ | | ポーランド・ズロチ | ポーランド・ズロチ | |
| | 6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024 | 150,000,000.000 | 160,489,500.000 | |
| | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923 | 50,000,000.000 | 56,698,000.000 | |
| ポーランド・ズロチ 小計 | | | ポーランド・ズロチ 217,187,500.000 (5,292,859,375) | |
| ユーロ | | ユーロ | ユーロ | |
| | 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704 | 11,000,000.000 | 17,616,060.000 | |
| | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104 | 10,500,000.000 | 16,972,620.000 | |
| | 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704 | 10,000,000.000 | 11,824,300.000 | |
| | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704 | 13,500,000.000 | 15,872,760.000 | |
| | 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704 | 3,500,000.000 | 3,640,700.000 | |
| | 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425 | 10,000,000.000 | 15,953,900.000 | |
| | 5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328 | 5,000,000.000 | 6,678,150.000 | |
| | 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328 | 20,000,000.000 | 23,112,200.000 | |
| | 6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715 | 32,000,000.000 | 47,803,200.000 | |
| | 4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315 | 17,000,000.000 | 21,424,760.000 | |
| ユーロ 小計 | | | ユーロ 180,898,650.000 (18,294,280,474) | |
| 国債証券 合計 | | | 64,236,798,754 [64,236,798,754] | |
| 特殊債券 | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | |
| | 6% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20170914 | 13,000,000.000 | 14,545,050.000 | |
| | 6% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20210614 | 30,000,000.000 | 35,137,200.000 | |
| | 6.25% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20190614 | 25,000,000.000 | 29,026,250.000 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | オーストラリア・ドル 78,708,500.000 (6,503,683,355) | |
| 特殊債券 合計 | | | 6,503,683,355 [6,503,683,355] | |
| 合計 | | | 70,740,482,109 [70,740,482,109] | |

(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 5銘柄 | 100% | 23.1% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 3銘柄 | 100% | 11.4% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 2銘柄 特殊債券 3銘柄 | 100% | 13.7% |
| カナダ・ドル | 国債証券 4銘柄 | 100% | 14.2% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 1銘柄 | 100% | 1.8% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 2銘柄 | 100% | 1.1% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 2銘柄 | 100% | 1.4% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 2銘柄 | 100% | 7.5% |
| ユーロ | 国債証券 10銘柄 | 100% | 25.8% |

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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 143,764,621 | 724,876,867 |
| 国債証券 | 257,583,923,937 | 296,077,847,949 |
| 未収入金 | 279,557,500 | - |
| 未収利息 | 1,155,675,135 | 1,332,133,142 |
| 前払費用 | 74,763,402 | 107,785,471 |
| 流動資産合計 | 259,237,684,595 | 298,242,643,429 |
| 資産合計 | 259,237,684,595 | 298,242,643,429 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | - | 503,434,800 |
| 未払解約金 | 306,357,440 | 8,005,816 |
| 流動負債合計 | 306,357,440 | 511,440,616 |
| 負債合計 | 306,357,440 | 511,440,616 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 226,247,203,255 | 256,655,052,686 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 32,684,123,900 | 41,076,150,127 |
| 元本等合計 | 258,931,327,155 | 297,731,202,813 |
| 純資産合計 | 258,931,327,155 | 297,731,202,813 |
| 負債純資産合計 | 259,237,684,595 | 298,242,643,429 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|----------------|------------------|------------------|
| 1. 1期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 164,650,681,050円 | 226,247,203,255円 |
| 期中追加設定元本額 | 70,480,678,192円 | 38,429,597,984円 |
| 期中一部解約元本額 | 8,884,155,987円 | 8,021,748,553円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ日本国債ファンドV A | 18,698,132円 | 43,438,952円 |
| （適格機関投資家専用） | | |

| | | |
|--|------------------|------------------|
| 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） | 792,895,946円 | 696,577,749円 |
| 安定重視ポートフォリオ（資産形成型） | 14,466,975円 | - 円 |
| 6 資産バランスファンド（分配型） | 725,154,847円 | 612,238,940円 |
| 6 資産バランスファンド（成長型） | 259,338,782円 | 245,486,376円 |
| ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型） | 222,934,800,502円 | 254,078,104,648円 |
| 世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型） | 349,618,165円 | 287,486,834円 |
| ダイワ・株ノ債券ノコモディティ・バランスファンド | 129,224,405円 | 119,682,946円 |
| ダイワ日本国債三分法（四半期分配型） | 39,911,844円 | - 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） | 983,093,657円 | 572,036,241円 |
| 計 | 226,247,203,255円 | 256,655,052,686円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 226,247,203,255口 | 256,655,052,686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24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 798,917,004 | 527,474,866 |
| 合計 | 798,917,004 | 527,474,866 |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年3月13日から平成24年5月10日まで、及び平成24年3月13日から平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 1.1445円 (11,445円) | 1.1600円 (11,600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 | 2 1 利付国債 2 0 年 | 2,389,000,000 | 2,435,155,480 | |
| | 2 2 利付国債 2 0 年 | 4,095,000,000 | 4,168,464,300 | |
| | 2 3 利付国債 2 0 年 | 12,596,000,000 | 13,173,652,560 | |
| | 2 4 利付国債 2 0 年 | 7,694,000,000 | 8,169,950,840 | |
| | 2 5 利付国債 2 0 年 | 118,000,000 | 124,348,400 | |
| | 2 7 利付国債 2 0 年 | 10,496,000,000 | 11,448,092,160 | |
| | 2 8 利付国債 2 0 年 | 9,338,000,000 | 10,409,722,260 | |
| | 2 9 利付国債 2 0 年 | 8,020,000,000 | 8,956,415,200 | |
| | 3 0 利付国債 2 0 年 | 47,000,000 | 51,818,910 | |
| | 3 2 利付国債 2 0 年 | 8,643,000,000 | 9,676,357,080 | |
| | 3 3 利付国債 2 0 年 | 8,884,000,000 | 10,132,735,040 | |
| | 3 4 利付国債 2 0 年 | 9,259,000,000 | 10,598,036,580 | |
| | 3 6 利付国債 2 0 年 | 1,270,000,000 | 1,442,161,200 | |
| | 3 7 利付国債 2 0 年 | 6,823,000,000 | 7,780,744,510 | |
| | 3 8 利付国債 2 0 年 | 8,816,000,000 | 9,976,273,760 | |
| | 4 0 2 0 年国債 | 8,482,000,000 | 9,484,402,760 | |
| | 4 2 2 0 年国債 | 7,478,000,000 | 8,556,925,840 | |
| | 4 3 2 0 年国債 | 9,692,000,000 | 11,348,944,320 | |
| | 4 4 2 0 年国債 | 8,095,000,000 | 9,304,635,850 | |
| | 4 7 2 0 年国債 | 9,160,000,000 | 10,371,776,400 | |
| | 4 8 2 0 年国債 | 6,191,000,000 | 7,163,420,369 | |
| | 4 9 2 0 年国債 | 3,728,000,000 | 4,199,368,320 | |
| | 5 1 2 0 年国債 | 230,000,000 | 257,489,600 | |
| | 5 2 2 0 年国債 | 7,168,000,000 | 8,088,729,600 | |
| 5 4 2 0 年国債 | 2,467,000,000 | 2,807,544,680 | | |

| | | | |
|---------|-------|----------------|-----------------|
| 55 | 20年国債 | 1,694,000,000 | 1,898,025,360 |
| 56 | 20年国債 | 5,160,000,000 | 5,781,418,800 |
| 58 | 20年国債 | 8,355,000,000 | 9,287,334,450 |
| 59 | 20年国債 | 95,000,000 | 103,763,750 |
| 63 | 20年国債 | 6,908,000,000 | 7,605,086,280 |
| 64 | 20年国債 | 10,745,000,000 | 11,930,818,200 |
| 65 | 20年国債 | 27,000,000 | 29,966,220 |
| 68 | 20年国債 | 9,705,000,000 | 11,077,869,300 |
| 70 | 20年国債 | 7,468,000,000 | 8,685,358,680 |
| 74 | 20年国債 | 4,905,000,000 | 5,538,088,350 |
| 75 | 20年国債 | 1,814,000,000 | 2,046,754,340 |
| 77 | 20年国債 | 1,716,000,000 | 1,916,137,080 |
| 80 | 20年国債 | 4,403,000,000 | 4,961,476,520 |
| 82 | 20年国債 | 4,725,000,000 | 5,316,759,000 |
| 83 | 20年国債 | 3,070,000,000 | 3,451,109,800 |
| 86 | 20年国債 | 4,430,000,000 | 5,081,121,400 |
| 88 | 20年国債 | 4,250,000,000 | 4,870,500,000 |
| 91 | 20年国債 | 5,760,000,000 | 6,594,624,000 |
| 95 | 20年国債 | 8,055,000,000 | 9,189,788,400 |
| 97 | 20年国債 | 9,400,000,000 | 10,584,682,000 |
| 国債証券 合計 | | | 296,077,847,949 |
| 合計 | | | 296,077,847,949 |

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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 3,288,556,204 | 1,637,846,787 |
| コール・ローン | 3,112,579,759 | 1,498,428,359 |
| 投資証券 | 293,126,368,444 | 196,308,530,044 |
| 派生商品評価勘定 | 4,190,549 | 11,072,245 |
| 未収入金 | 3,283,558,517 | 5,919,635,208 |
| 未収配当金 | 1,794,297,387 | 452,252,195 |
| 流動資産合計 | 304,609,550,860 | 205,827,764,838 |
| 資産合計 | 304,609,550,860 | 205,827,764,838 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,398,155 | 6,342,921 |
| 未払金 | 223,387,947 | 1,586,884,391 |
| 未払解約金 | 3,181,100,000 | 2,915,050,000 |
| 流動負債合計 | 3,405,886,102 | 4,508,277,312 |
| 負債合計 | 3,405,886,102 | 4,508,277,312 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 320,929,771,290 | 201,964,652,128 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2 19,726,106,532 | 645,164,602 |
| 元本等合計 | 301,203,664,758 | 201,319,487,526 |
| 純資産合計 | 301,203,664,758 | 201,319,487,526 |
| 負債純資産合計 | 304,609,550,860 | 205,827,764,838 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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、原則として期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、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>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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|------------------|------------------|
| 1. 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 501,144,385,526円 | 320,929,771,290円 |
| 期中追加設定元本額 | 600,521,079円 | 3,133,951,665円 |
| 期中一部解約元本額 | 180,815,135,315円 | 122,099,070,827円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ・グローバルREIT・ | 298,239,280,228円 | 181,553,455,977円 |
| オープン（毎月分配型） | | |
| ダイワ・バランス3資産（外債 | 107,808,624円 | 96,950,239円 |
| ・海外リート・好配当日本株） | | |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数 | 131,673,689円 | 110,373,918円 |
| 月分配型） | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 137,117,832円 | 106,204,473円 |
| （奇数月分配型） | | |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数 | 482,848,428円 | 395,805,924円 |
| 月分配型） | | |
| 安定重視ポートフォリオ（資産 | 2,450,807円 | - 円 |
| 形成型） | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 4,034,356円 | - 円 |
| （資産形成型） | | |
| 成長重視ポートフォリオ（資産 | 10,900,256円 | - 円 |
| 形成型） | | |
| 6 資産バランスファンド（分配 | 874,753,506円 | 690,732,851円 |
| 型） | | |
| 6 資産バランスファンド（成長 | 1,309,237,175円 | 1,151,831,674円 |
| 型） | | |
| ダイワ三資産分散ファンド（イン | 87,454,002円 | 71,804,150円 |
| カム&キャッシュ、外債、内外 | | |
| リート）（隔月分配型） | | |
| りそな ワールド・リート・ | 13,263,603,411円 | 10,259,545,140円 |
| ファンド | | |
| 世界6 資産均等分散ファンド | 439,687,522円 | 326,672,126円 |
| （毎月分配型） | | |
| 『しがぎん』SRI三資産バラ | 24,653,258円 | 20,097,008円 |
| ンス・オープン（奇数月分配 | | |
| 型） | | |
| 常陽3 分法ファンド | 1,709,721,268円 | 1,377,715,402円 |

| | | |
|------------------------------|---|---|
| ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) | 394,472,638円 | 328,364,486円 |
| ダイワ・海外株式&REITファンド(毎月分配型) | 99,326,441円 | 81,366,883円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) | 160,272,709円 | 165,844,742円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) | 175,149,173円 | 179,777,733円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) | 157,306,114円 | 166,197,122円 |
| ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用) | 1,506,440,777円 | 3,520,419,878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) | 1,611,579,076円 | 1,361,492,402円 |
| 計 | 320,929,771,290円 | 201,964,652,128円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 320,929,771,290口 | 201,964,652,128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19,726,106,532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645,164,602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24年5月11日 至平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 5,617,336,286 | 4,174,272,004 |
| 合計 | 5,617,336,286 | 4,174,272,004 |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年3月16日から平成24年5月10日まで、及び平成24年9月19日から平成24年11月12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24年5月10日 現在 | | | | 平成24年11月12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 | 3,559,235,505 | - | 3,555,101,845 | 4,133,660 | 5,117,072,348 | - | 5,106,412,188 | 10,660,160 |
| アメリカ・ド ル | 2,925,450,730 | - | 2,921,751,265 | 3,699,465 | 3,357,815,256 | - | 3,357,374,552 | 440,704 |
| イギリス・ポ ンド | 388,607,937 | - | 388,204,543 | 403,394 | 664,167,124 | - | 659,727,793 | 4,439,331 |
| カナダ・ドル | 245,176,838 | - | 245,146,037 | 30,801 | 433,118,374 | - | 433,113,143 | 5,231 |
| ユーロ | - | - | - | - | 661,971,594 | - | 656,196,700 | 5,774,894 |
| 買 建 | 765,865,005 | - | 764,523,739 | 1,341,266 | 2,891,016,348 | - | 2,885,085,512 | 5,930,836 |
| アメリカ・ド ル | 633,784,775 | - | 633,004,998 | 779,777 | 1,759,257,092 | - | 1,754,961,448 | 4,295,644 |
| オーストラリ ア | 132,080,230 | - | 131,518,741 | 561,489 | 394,928,894 | - | 394,734,680 | 194,214 |
| ・ドル | - | - | - | - | 293,516,166 | - | 293,279,791 | 236,375 |
| シンガポール ・ドル | - | - | - | - | 443,314,196 | - | 442,109,593 | 1,204,603 |
| ユーロ | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | 4,325,100,510 | - | 4,319,625,584 | 2,792,394 | 8,008,088,696 | - | 7,991,497,700 | 4,729,324 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9385円 (9,385円) | 0.9968円 (9,968円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|---------------------------|-----------|-----------------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 168,197 | 22,190,230.210 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 852,573 | 129,591,096.000 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 229,646 | 23,676,502.600 | |
| | | APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 1,647,853 | 41,822,509.140 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 1,856,062 | 35,042,450.560 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 852,316 | 65,901,073.120 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 905,139 | 51,285,175.740 | |
| | | LASALLE HOTEL 7.5 H | 188,970 | 4,839,521.700 | |
| | | HOST HOTELS&RESORTS INC | 2,265,316 | 32,258,099.840 | |
| | | DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 263,745 | 5,504,358.150 | |
| | | HUDSON PACIFIC PROP B | 100,000 | 2,773,000.000 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 914,225 | 17,315,421.500 | |
| | | KIMCO REALTY 6.90% H | 342,615 | 9,171,803.550 | |
| | | SOVRAN SELF STORAGE INC | 254,991 | 15,605,449.200 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 520,434 | 14,275,504.620 | |
| | | VENTAS INC | 662,711 | 42,208,063.590 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE 6.75 C | 212,929 | 5,674,557.850 | |
| | | ASSOCIATED ESTATES REALTY | 945,099 | 14,138,681.040 | |
| | | PROLOGIS INC | 1,406,668 | 46,968,644.520 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ | 263,424 | 17,767,948.800 | |
| | | BRE PROPERTIES-CL A | 202,164 | 9,982,858.320 | |
| | | MACK-CALI REALTY CORP | 395,842 | 10,058,345.220 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 303,189 | 31,425,539.850 | |
| | | HEALTH CARE REIT INC | 400,977 | 23,513,291.280 | |
| | | HCP INC | 1,080,509 | 47,704,472.350 | |
| | | KILROY REALTY CORP | 159,051 | 7,084,131.540 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COM | 199,310 | 12,448,902.600 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 237,397 | 34,588,742.900 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 488,773 | 22,781,709.530 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 384,675 | 28,223,604.750 | |
| | | SENIOR HOUSING PROP TRUST | 658,995 | 14,695,588.500 | |
| | | TAUBMAN CENTERS INC | 157,228 | 12,183,597.720 | |

| | | | |
|------------|---------------------------|------------|--|
| | UDR INC | 469,803 | 11,012,182.320 |
| | DDR CORP 7.375 H | 375,076 | 9,474,419.760 |
| | SL GREEN REALTY 7.625% C | 608,282 | 15,480,776.900 |
| | PROLOGIS TRUST 6.75% R | 327,570 | 8,222,007.000 |
| | DUKE REALTY CORP 8.375 O | 285,032 | 7,385,179.120 |
| | CUBESMART | 1,067,632 | 13,996,655.520 |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 213,978 | 13,129,690.080 |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 231,499 | 8,169,599.710 |
| | HERSHA HOSPITALITY TRUST | 3,477,945 | 15,581,193.600 |
| | CBL&ASSOC PROP 7.375% D | 387,166 | 9,888,219.640 |
| | VORNADO RLTY TST 6.625% G | 293,814 | 7,418,803.500 |
| | AMERICAN CAMPUS COMMUNITI | 110,700 | 4,954,932.000 |
| | EDUCATION REALTY TRUST | 1,286,658 | 12,969,512.640 |
| | SUNSTONE HOTEL 8% A | 208,950 | 5,263,450.500 |
| | DIAMONDROCK HOSPITALITY | 2,205,731 | 18,748,713.500 |
| | VORNADO REALTY TST 6.75%F | 131,527 | 3,328,948.370 |
| | DUKE REALTY CORP 6.60% L | 357,113 | 8,988,534.210 |
| | DOUGLAS EMMETT | 551,420 | 12,500,691.400 |
| | LASALLE HOTEL G | 286,225 | 7,313,048.750 |
| | BIOMED REALTY 7.375 A | 301,348 | 7,792,859.280 |
| | WEINGARTEN RLTY F | 392,127 | 9,901,206.750 |
| | LEXINGTON REALTY D | 182,943 | 4,601,016.450 |
| | HOSPITALITY PROP C | 212,031 | 5,353,782.750 |
| | PUBLIC STORAGE 6.875 O | 92,400 | 2,540,076.000 |
| | DUPONT FABROS 7.625 B | 350,000 | 9,310,000.000 |
| | COMMONWEALTH REIT 7.25 E | 500,000 | 12,800,000.000 |
| | TAUBMAN CENTERS 6.5 J | 99,300 | 2,552,010.000 |
| | GLIMCHER REALTY 7.5 H | 199,751 | 5,077,670.420 |
| | DDR CORP 6.5 J | 220,000 | 5,484,600.000 |
| | COMMONWEALTH REIT 6.5% D | 786,884 | 18,806,527.600 |
| | PEBBLEBROOK HOTEL 7.875 A | 244,400 | 6,305,520.000 |
| | アメリカ・ドル 小計 | | アメリカ・ドル 1,137,052,704.060 (90,407,060,500) |
| イギリス・ポンド | | | イギリス・ポンド |
| | LAND SECURITIES PLC | 5,362,588 | 42,284,006.380 |
| | SEGRO PLC | 6,790,582 | 15,414,621.140 |
| | HAMMERSON PLC | 7,570,946 | 35,394,172.550 |
| | BRITISH LAND CO PLC | 6,720,048 | 34,977,849.840 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PL | 3,373,031 | 15,593,522.310 |
| | DERWENT LONDON PLC | 782,465 | 15,962,286.000 |
| | イギリス・ポンド 小計 | | イギリス・ポンド 159,626,458.220 (20,176,784,319) |
| オーストラリア・ドル | | | オーストラリア・ドル |
| | WESTFIELD RETAIL TRUST | 25,668,212 | 79,571,457.200 |
| | COMMONWEALTH PROPERTY OFF | 23,241,346 | 24,287,206.570 |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 52,693,544 | 52,166,608.560 |
| | GPT GROUP | 16,105,887 | 56,048,486.760 |
| | MIRVAC GROUP | 28,587,011 | 41,451,165.950 |
| | STOCKLAND | 14,518,780 | 49,799,415.400 |
| | WESTFIELD GROUP | 12,013,175 | 125,537,678.750 |
| | GOODMAN GROUP | 6,532,939 | 28,875,590.380 |
| | CENTRO RETAIL AUSTRALIA | 14,574,000 | 31,479,840.000 |
| | オーストラリア・ドル 小計 | | オーストラリア・ドル |

| | | | |
|--------------|---------------------------|------------|--|
| | | | 489,217,449.570 (40,424,037,858) |
| カナダ・ドル | | | カナダ・ドル |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST | 1,431,212 | 38,399,417.960 |
| | DUNDEE REAL ESTATE INVEST | 352,825 | 12,426,496.500 |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INV | 201,746 | 12,748,329.740 |
| | PRIMARIS RETAIL REAL ESTA | 1,099,527 | 25,014,239.250 |
| カナダ・ドル 小計 | | | カナダ・ドル 88,588,483.450 (7,041,898,550) |
| シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル |
| | CAPITACOMMERCIAL TRUST | 30,257,800 | 46,597,012.000 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV | 8,072,500 | 18,566,750.000 |
| | CAPITAMALL TRUST | 30,414,392 | 62,653,647.520 |
| | SUNTEC REIT | 5,883,000 | 9,118,650.000 |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 11,651,222 | 22,370,346.240 |
| シンガポール・ドル 小計 | | | シンガポール・ドル 159,306,405.760 (10,348,544,118) |
| ユーロ | | | ユーロ |
| | ALSTRIA OFFICE REIT | 869,918 | 7,929,302.570 |
| | CORIO NV | 728,209 | 23,513,868.610 |
| | EUROCOMMERCIAL -CVA | 337,621 | 9,301,458.550 |
| | ICADE | 170,200 | 11,590,620.000 |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 585,487 | 98,947,303.000 |
| | GECINA SA | 123,400 | 10,613,634.000 |
| | KLEPIERRE | 1,051,879 | 29,505,205.950 |
| | MERCIALYS | 272,259 | 4,342,531.050 |
| ユーロ 小計 | | | ユーロ 195,743,923.730 (19,795,583,007) |
| 香港・ドル | | | 香港・ドル |
| | LINK REIT | 14,956,920 | 593,041,878.000 |
| | CHAMPION REIT | 54,207,376 | 197,856,922.400 |
| 香港・ドル 小計 | | | 香港・ドル 790,898,800.400 (8,114,621,692) |
| 投資証券 合計 | | | 196,308,530,044 [196,308,530,044] |
| 合計 | | | 196,308,530,044 [196,308,530,044] |

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 63銘柄 | 100% | 46.0% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 6銘柄 | 100% | 10.3% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 9銘柄 | 100% | 20.6% |
| カナダ・ドル | 投資証券 4銘柄 | 100% | 3.6% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 5銘柄 | 100% | 5.3% |
| ユーロ | 投資証券 8銘柄 | 100% | 10.1% |

| | | | | |
|-------|------|-----|------|------|
| 香港・ドル | 投資証券 | 2銘柄 | 100% | 4.1% |
|-------|------|-----|------|------|

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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|------------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 118,091,070 | 54,431,592 |
| 投資証券 | 10,837,906,970 | 11,283,200,000 |
| 未収入金 | 53,262,524 | 64,193,511 |
| 未収配当金 | 149,131,660 | 123,449,600 |
| 流動資産合計 | 11,158,392,224 | 11,525,274,703 |
| 資産合計 | 11,158,392,224 | 11,525,274,703 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 43,477,790 | 57,167,980 |
| 未払解約金 | 37,500,000 | 16,120,000 |
| 流動負債合計 | 80,977,790 | 73,287,980 |
| 負債合計 | 80,977,790 | 73,287,980 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 11,290,463,183 | 10,397,059,411 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2 213,048,749 | 1,054,927,312 |
| 元本等合計 | 11,077,414,434 | 11,451,986,723 |
| 純資産合計 | 11,077,414,434 | 11,451,986,723 |
| 負債純資産合計 | 11,158,392,224 | 11,525,274,703 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 12,212,187,830円 | 11,290,463,183円 |
| 期中追加設定元本額 | 328,554,298円 | 402,715,236円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,250,278,945円 | 1,296,119,008円 |
| 期末元本額の内訳 ファンド名 | | |

| | | |
|--|---|-----------------|
| 安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) | 126,777,049円 | 99,742,268円 |
| インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) | 130,566,437円 | 95,921,597円 |
| 成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) | 462,957,735円 | 357,756,210円 |
| 安定重視ポートフォリオ(資産形成型) | 2,301,106円 | -円 |
| インカム重視ポートフォリオ(資産形成型) | 3,823,784円 | -円 |
| 成長重視ポートフォリオ(資産形成型) | 10,411,376円 | -円 |
| 6資産バランスファンド(分配型) | 835,901,818円 | 625,429,087円 |
| 6資産バランスファンド(成長型) | 1,258,286,966円 | 1,048,493,199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) | 82,749,679円 | 65,681,862円 |
| 世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型) | 413,370,810円 | 290,674,345円 |
| 『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型) | 11,711,329円 | 9,029,202円 |
| ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) | 374,401,449円 | 296,310,437円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) | 152,477,909円 | 150,631,541円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) | 167,581,125円 | 160,901,020円 |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) | 149,847,278円 | 150,000,495円 |
| DCダイワJ-REITアクティブファンド | 110,964,049円 | 171,450,012円 |
| ダイワファンドラップJ-REITセレクト | 5,886,554,778円 | 5,953,401,121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) | 277,670,750円 | 220,304,670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) | 109,877,337円 | 98,066,987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) | 493,416,799円 | 393,945,956円 |
| ダイワJリート・ファンド | 228,813,620円 | 209,319,402円 |
| 計 | 11,290,463,183円 | 10,397,059,411円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 11,290,463,183口 | 10,397,059,411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213,048,749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24年5月11日 至平成24年11月12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す。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|------|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 1,004,035,085 | 980,361,274 |
| 合計 | 1,004,035,085 | 980,361,274 |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年11月11日から平成24年5月10日まで、及び平成24年5月11日から平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9811円 (9,811円) | 1.1015円 (11,015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 | 600 | 325,800,000 | |
| | 森ヒルズリート | 1,000 | 379,000,000 | |
| | 野村不レジデンシャル | 500 | 236,250,000 | |
| | 産業ファンド | 650 | 394,550,000 | |
| | アドバンス・レジデンス | 3,300 | 538,560,000 | |
| | A P I 投資法人 | 800 | 415,200,000 | |
| | 日本ビルファンド | 1,900 | 1,609,300,000 | |
| | ジャパンリアルエステイト | 1,771 | 1,390,235,000 | |
| | 日本リテールファンド | 5,200 | 743,600,000 | |
| | オリックス不動産投資 | 650 | 244,725,000 | |
| | 日本プライムリアルティ | 1,700 | 395,590,000 | |
| | プレミアム投資法人 | 300 | 84,630,000 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 100 | 45,950,000 | |
| | 野村不動産オフィスF | 1,100 | 518,100,000 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 3,700 | 353,720,000 | |
| | 森トラスト総合リート | 1,200 | 847,200,000 | |
| | フロンティア不動産投資 | 650 | 440,050,000 | |
| | 平和不動産リート | 3,000 | 160,800,000 | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 300 | 213,000,000 | |
| | 福岡リート投資法人 | 350 | 203,350,000 | |
| | ケネディクス不動産投資法人 | 600 | 159,000,000 | |
| | いちご不動産投資法人 | 4,700 | 192,465,000 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 1,000 | 250,000,000 | |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 500 | 300,000,000 | | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 14,000 | 313,600,000 | | |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 4,170 | 193,905,000 | | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 780 | 334,620,000 | | |
| 投資証券 合計 | | | 11,283,200,000 | |
| 合計 | | | 11,283,200,000 | |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 | |
|-----------------|---------------|---------------|---------------|
| | 金額（円） | 金額（円） | |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | 26,794,037 | 90,320,318 | |
| コール・ローン | 41,395,473 | 15,038,458 | |
| 株式 | 1,557,614,040 | 1,377,102,178 | |
| ハイブリッド優先証券 | 492,300,485 | 450,868,161 | |
| 投資証券 | 48,669,156 | 45,529,156 | |
| 派生商品評価勘定 | - | 139,950 | |
| 未収入金 | 11,216,892 | 6,784,871 | |
| 未収配当金 | 1,924,661 | 1,893,494 | |
| 未収利息 | 459,092 | 595,099 | |
| 流動資産合計 | 2,180,373,836 | 1,988,271,685 | |
| 資産合計 | 2,180,373,836 | 1,988,271,685 | |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | - | 2,883,390 | |
| 未払解約金 | 12,650,000 | 19,000,000 | |
| 流動負債合計 | 12,650,000 | 21,883,390 | |
| 負債合計 | 12,650,000 | 21,883,390 | |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 2,344,771,828 | 2,053,305,510 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2 | 177,047,992 | 86,917,215 |
| 元本等合計 | | 2,167,723,836 | 1,966,388,295 |
| 純資産合計 | | 2,167,723,836 | 1,966,388,295 |
| 負債純資産合計 | | 2,180,373,836 | 1,988,271,685 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(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。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券 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。</p> |

| | |
|----------------------------|---|
| | <p>(3)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。</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、原則として期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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----|----------------|----------------|----------------|
| 1. | 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| | 期首元本額 | 2,779,842,708円 | 2,344,771,828円 |
| | 期中追加設定元本額 | 19,288,013円 | 36,738,686円 |
| | 期中一部解約元本額 | 454,358,893円 | 328,205,004円 |
| | 期末元本額の内訳 | | |
| | ファンド名 | | |
| | ダイワ・グローバル好配当株 | 220,632,128円 | 188,856,258円 |
| | ファンド(毎月分配型) | | |
| | 安定重視ポートフォリオ(奇数 | 88,342,535円 | 74,240,185円 |
| | 月分配型) | | |
| | インカム重視ポートフォリオ | 90,224,197円 | 71,661,640円 |
| | (奇数月分配型) | | |
| | 成長重視ポートフォリオ(奇数 | 1,149,330,995円 | 976,863,946円 |
| | 月分配型) | | |
| | 安定重視ポートフォリオ(資産 | 1,574,776円 | - 円 |
| | 形成型) | | |
| | インカム重視ポートフォリオ | 2,562,796円 | - 円 |
| | (資産形成型) | | |

| | | |
|-----------------------------|---|--|
| 成長重視ポートフォリオ（資産形成型） | 25,924,765円 | - 円 |
| ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド | 206,357,744円 | 185,982,285円 |
| ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） | 257,714,737円 | 223,381,878円 |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） | 67,697,667円 | 74,310,328円 |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） | 110,895,637円 | 119,374,630円 |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） | 123,513,851円 | 138,634,360円 |
| 計 | 2,344,771,828円 | 2,053,305,510円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 2,344,771,828口 | 2,053,305,510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177,047,992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86,917,215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24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 30,943,022 | 47,211,475 |
| ハイブリッド優先証券 | 2,168,976 | 3,355,343 |
| 投資証券 | 507,771 | 141,894 |
| 合計 | 28,266,275 | 50,424,924 |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年4月17日から平成24年5月10日まで、及び平成24年10月16日から平成24年11月12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24年5月10日 現在 | | | | 平成24年11月12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 | - | - | - | - | 23,989,950 | - | 23,850,000 | 139,950 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 23,989,950 | - | 23,850,000 | 139,950 |
| 合計 | - | - | - | - | 23,989,950 | - | 23,850,000 | 139,950 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.9245円 | 0.9577円 |
| (1万口当たり純資産額) | (9,245円) | (9,577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 | 3,300 | 64.840 | 213,972.000 | |
| | AFLAC INC | 2,300 | 49.620 | 114,126.000 | |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 3,400 | 26.770 | 91,018.000 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 4,200 | 53.830 | 226,086.000 | |
| | CITIGROUP INC | 4,500 | 35.930 | 161,685.000 | |
| | COVIDIEN PLC | 4,600 | 55.590 | 255,714.000 | |
| | APPLE INC | 825 | 547.060 | 451,324.500 | |
| | BECTON DICKINSON & CO | 2,300 | 75.230 | 173,029.000 | |
| | BANK OF NEW YORK MELLON | 4,200 | 24.110 | 101,262.000 | |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 11,000 | 40.620 | 446,820.000 | |
| | CISCO SYSTEMS | 21,200 | 16.820 | 356,584.000 | |
| | DOW CHEMICAL | 3,100 | 29.360 | 91,016.000 | |
| | COSTCO WHOLESALE CORP | 1,800 | 95.460 | 171,828.000 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 5,500 | 87.210 | 479,655.000 | |
| | L-3 COMMUNICATIONS HLDGS | 3,900 | 74.470 | 290,433.000 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 3,300 | 67.380 | 222,354.000 | |
| | FREEMONT-MCMORAN COPPER | 2,800 | 38.350 | 107,380.000 | |
| | US BANCORP | 6,500 | 32.100 | 208,650.000 | |
| | GENERAL ELECTRIC CO | 8,500 | 21.000 | 178,500.000 | |
| | GENERAL DYNAMICS CORP | 700 | 64.450 | 45,115.000 | |
| | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 1,000 | 116.150 | 116,150.000 | |
| | HARRIS CORP | 2,500 | 48.650 | 121,625.000 | |
| | INT'L BUSINESS MACHINES | 1,800 | 189.640 | 341,352.000 | |
| | JOHNSON & JOHNSON | 4,000 | 69.870 | 279,480.000 | |
| | MCDONALD'S CORP | 4,900 | 84.740 | 415,226.000 | |
| | MERCK & CO INC | 6,000 | 44.050 | 264,300.000 | |
| | NIKE INC -CL B | 500 | 92.310 | 46,155.000 | |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 3,600 | 58.000 | 208,800.000 | |
| | NEWMONT MINING CORP | 1,400 | 48.070 | 67,298.000 | |
| | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 5,100 | 85.420 | 435,642.000 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM | 3,300 | 76.650 | 252,945.000 | |
| | PFIZER INC | 13,900 | 24.170 | 335,963.000 | |
| | PARKER HANNIFIN CORP | 1,200 | 79.090 | 94,908.000 | |
| | PROCTER & GAMBLE CO | 3,400 | 67.010 | 227,834.000 | |
| | PEPSICO INC | 3,800 | 68.850 | 261,630.000 | |
| | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 3,300 | 52.710 | 173,943.000 | |
| | ACCENTURE LTD-CL A | 2,100 | 65.810 | 138,201.000 | |
| | QUALCOMM INC | 5,900 | 61.620 | 363,558.000 | |
| | REPUBLIC SERVICES INC | 6,800 | 26.750 | 181,900.000 | |
| | ROSS STORES INC | 2,700 | 55.220 | 149,094.000 | |
| CHEVRON CORP | 4,800 | 105.840 | 508,032.000 | | |
| SYMANTEC CORP | 5,000 | 17.970 | 89,850.000 | | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 1,300 | 68.730 | 89,349.000 | | |
| SCHLUMBERGER LTD | 2,600 | 68.370 | 177,762.000 | | |
| AT&T INC | 10,000 | 33.540 | 335,400.000 | | |
| SEMPRA ENERGY | 2,900 | 65.790 | 190,791.000 | | |
| TIFFANY & CO | 1,500 | 60.990 | 91,485.000 | | |
| TIMKEN CO | 1,300 | 38.660 | 50,258.000 | | |

| | | | | |
|------------|---------------------------|--------|---------|--|
| | TIME WARNER CABLE | 3,500 | 93.100 | 325,850.000 |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 3,300 | 53.120 | 175,296.000 |
| | UNITED TECHNOLOGIES | 2,400 | 75.840 | 182,016.000 |
| | UNITED PARCEL SERVICE-B | 5,000 | 72.250 | 361,250.000 |
| | UNITEDHEALTH GROUP INC | 6,600 | 52.900 | 349,140.000 |
| | THE WALT DISNEY CO. | 5,300 | 47.060 | 249,418.000 |
| | WELLS FARGO & CO | 8,300 | 32.350 | 268,505.000 |
| | WAL-MART STORES | 2,400 | 72.310 | 173,544.000 |
| | WESTAR ENERGY INC | 6,500 | 28.380 | 184,470.000 |
| | VISA INC-CLASS A SHS | 2,100 | 142.930 | 300,153.000 |
| | ORACLE CORPORATION | 13,200 | 30.350 | 400,620.000 |
| | NORDSTROM INC | 3,400 | 54.790 | 186,286.000 |
| | AMERICAN EXPRESS CO | 4,100 | 55.830 | 228,903.000 |
| | EMERSON ELECTRIC CO | 5,700 | 50.150 | 285,855.000 |
| | CHUBB CORP | 1,800 | 74.750 | 134,550.000 |
| | INTEL CORP | 11,800 | 20.800 | 245,440.000 |
| | COMERICA INC | 3,200 | 28.440 | 91,008.000 |
| | JOHNSON CONTROLS INC | 6,200 | 25.520 | 158,224.000 |
| | MICROSOFT CORP | 14,600 | 28.830 | 420,918.000 |
| | CVS CAREMARK CORP | 7,600 | 46.360 | 352,336.000 |
| | BLACKROCK INC-CLASS A | 1,500 | 186.830 | 280,245.000 |
| | APACHE CORP | 1,100 | 78.560 | 86,416.000 |
| | PETSMART INC | 1,400 | 65.990 | 92,386.000 |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | アメリカ・ドル 15,928,311.500 (1,266,460,047) |
| カナダ・ドル | 株 | | カナダ・ドル | カナダ・ドル |
| | SUNCOR ENERGY INC | 5,600 | 33.260 | 186,256.000 |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 1,200 | 80.060 | 96,072.000 |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 1,900 | 55.850 | 106,115.000 |
| | TRANSCANADA CORP | 4,200 | 44.800 | 188,160.000 |
| | POTASH CORP OF SASKATCHEW | 4,400 | 39.040 | 171,776.000 |
| | ROGERS COMMUNICATIONS-B | 6,200 | 43.520 | 269,824.000 |
| | POWER CORP OF CANADA | 7,900 | 24.650 | 194,735.000 |
| | FINNING INTERNATIONAL INC | 3,900 | 23.000 | 89,700.000 |
| | TIM HORTONS INC | 1,900 | 46.980 | 89,262.000 |
| カナダ・ドル 小計 | | | | カナダ・ドル 1,391,900.000 (110,642,131) |
| 合計 | | | | 1,377,102,178 [1,377,102,178] |

(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 | 50,320.000 | |
| | | FIRST NIAGARA FIN VAR | 5,862.000 | 170,584.200 | |
| | | DTE ENERGY COMPANY 6.5 | 5,000.000 | 142,200.000 | |
| | | TELEPHONE & DATA 6.875 | 4,375.000 | 119,262.500 | |
| | | SEASpan CORPORATION 9.5 | 6,130.000 | 171,088.300 | |
| | | ALLY FINANCIAL 7.3 | 7,605.000 | 189,440.550 | |
| | | ZIONS BK C 9.5 | 6,777.000 | 179,726.040 | |
| | | MONTPELIER RE 8.875 | 4,000.000 | 107,800.000 | |
| | | AXIS CAPITAL HLDG 6.875 | 4,013.000 | 106,384.630 | |
| | | FIRST REPUBLIC BANK 6.7 | 4,000.000 | 108,440.000 | |
| | | FIRST REPUBLIC BANK 6.2 | 2,500.000 | 65,100.000 | |

| | | | | |
|---------------|---------|--------------------------|------------|---|
| | | NEXTERA ENERGY CAP H | 7,000.000 | 186,970.000 |
| | | CHARLES SCHWAB CORP B | 2,800.000 | 73,976.000 |
| | | DTE ENERGY COMPANY 5.25 | 7,000.000 | 177,590.000 |
| | | ASPEN INSURANCE 7.25 | 2,300.000 | 59,593.000 |
| | | REGIONS FINANCIAL 6.375 | 3,500.000 | 86,590.000 |
| | | AFFILIATED MGRS 6.375 | 6,000.000 | 154,740.000 |
| | | SCE TRUST I F 5.625 | 5,000.000 | 130,450.000 |
| | | JPMCHASE CAP XVI 6.350 | 4,400.000 | 112,772.000 |
| | | COUNTRYWIDE CAP IV 6.75 | 1,925.000 | 48,452.250 |
| | | METLIFE B 6.500 | 2,900.000 | 74,414.000 |
| | | BGE CAPITAL TR II 6.200 | 2,288.000 | 58,458.400 |
| | | FPC CAPITAL I 7.100 | 1,577.000 | 41,065.080 |
| | | PINCIPAL FINL GRP 6.518 | 2,000.000 | 53,040.000 |
| | | GOLDMAN SACHS GROUP 6.5 | 2,000.000 | 53,500.000 |
| | | CITIGROUP CAP VIII 6.95 | 7,033.000 | 178,075.560 |
| | | JPMCHASE CAP XIX 6.625 | 2,600.000 | 66,222.000 |
| | | MORGAN S CP TR VII 6.60 | 2,099.000 | 52,579.950 |
| | | COUNTRYWIDE CAP V 7.00% | 5,928.000 | 148,496.400 |
| | | ASPEN INSURANCE HLDG A | 1,583.000 | 42,361.080 |
| | | PRIVATEBANCORP 7.125 | 4,000.000 | 101,560.000 |
| | | WELLS F CAP J 8.0 | 5,100.000 | 155,448.000 |
| | | AIG 7.70 A-5 | 5,000.000 | 127,150.000 |
| | | AMER FINL GROUP 7.0 | 4,169.000 | 115,064.400 |
| | | US BANCORP VAR | 10,000.000 | 290,100.000 |
| | | RAYMOND JAMES 6.9 | 12,000.000 | 329,520.000 |
| | | ARCH CAPITAL GRP C 6.75 | 4,000.000 | 106,120.000 |
| | | PNC FINANCIAL VAR | 9,000.000 | 249,480.000 |
| | | STANLEY BLACK & D 5.75 | 7,000.000 | 183,470.000 |
| | | AMER FINL GROUP 6.375 | 2,800.000 | 73,920.000 |
| | | QWEST CORPORATION 7.0 B | 11,000.000 | 293,150.000 |
| | | RGA 6.2 | 2,000.000 | 54,140.000 |
| | | CAPITAL ONE FINANCIAL 6 | 3,000.000 | 75,810.000 |
| | | HARTFORD FINL SVCS VAR | 7,000.000 | 199,360.000 |
| | | ENDURANCE SPECIALTY 7.5 | 4,000.000 | 106,600.000 |
| | | アメリカ・ドル 小計 | | アメリカ・ドル 5,670,584.340 (450,868,161) |
| ハイブリッド優先証券 合計 | | | | |
| | | | | 450,868,161 [450,868,161] |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル |
| | | ENTERTAINMENT PROP 9.0 E | 2,000 | 59,900.000 |
| | | COUSINS PROPERTY 7.75% A | 2,470 | 61,651.200 |
| | | LEXINGTON REALTY D | 3,500 | 88,025.000 |
| | | STAG INDUSTRIAL 9.0 A | 1,485 | 40,689.000 |
| | | DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 2,945 | 78,337.000 |
| | | CORP OFF PROP TR 7.375 L | 4,898 | 128,327.600 |
| | | CHESAPEAKE LODG 7.75 | 3,494 | 92,591.000 |
| | | URSTADT BIDDLE 7.125 F | 894 | 23,100.960 |
| | | アメリカ・ドル 小計 | | アメリカ・ドル 572,621.760 (45,529,156) |
| 投資証券 合計 | | | | |
| | | | | 45,529,156 [45,529,156] |
| 合計 | | | | |
| | | | | 496,397,317 [496,397,317] |

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 優先証券 45銘柄 投資証券 8銘柄 | 71.8% | 25.6% | 2.6% | 94.1% |
| カナダ・ドル | 株式 9銘柄 | 100% | -% | -% | 5.9% |

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|-----------------|---------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 29,771,367 | 24,604,079 |
| コール・ローン | 30,544,140 | 25,501,501 |
| 株式 | 1,897,835,544 | 1,756,990,577 |
| 未収配当金 | 12,384,075 | 1,867,332 |
| 流動資産合計 | 1,970,535,126 | 1,808,963,489 |
| 資産合計 | 1,970,535,126 | 1,808,963,489 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 7,500,000 |
| 流動負債合計 | - | 7,500,000 |
| 負債合計 | - | 7,500,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 2,629,841,011 | 2,217,154,794 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2 659,305,885 | 415,691,305 |
| 元本等合計 | 1,970,535,126 | 1,801,463,489 |
| 純資産合計 | 1,970,535,126 | 1,801,463,489 |
| 負債純資産合計 | 1,970,535,126 | 1,808,963,489 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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、原則として期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 | <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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|------------------|---|---|
| 1. 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 2,914,742,570円 | 2,629,841,011円 |
| 期中追加設定元本額 | 60,770,215円 | 14,108,388円 |
| 期中一部解約元本額 | 345,671,774円 | 426,794,605円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ・グローバル好配当株 | 263,749,148円 | 223,449,845円 |
| ファンド(毎月分配型) | | |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数 | 104,720,999円 | 89,170,342円 |
| 月分配型） | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 107,803,701円 | 84,966,684円 |
| （奇数月分配型） | | |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数 | 1,394,423,087円 | 1,154,155,674円 |
| 月分配型） | | |
| 安定重視ポートフォリオ（資産 | 1,903,303円 | - 円 |
| 形成型） | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 3,059,627円 | - 円 |
| （資産形成型） | | |
| 成長重視ポートフォリオ（資産 | 31,558,777円 | - 円 |
| 形成型） | | |
| ダイワ・株/債券/コモディ | 247,182,307円 | 220,496,920円 |
| ティ・バランスファンド | | |
| ダイワ資産分散インカムオー | 303,044,094円 | 265,842,616円 |
| ン（奇数月決算型） | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 38,728,967円 | 39,502,461円 |
| （六つの羽/安定コース） | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 62,337,056円 | 63,849,553円 |
| （六つの羽/6分散コース） | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 71,329,945円 | 75,720,699円 |
| （六つの羽/成長コース） | | |
| 計 | 2,629,841,011円 | 2,217,154,794円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 2,629,841,011口 | 2,217,154,794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659,305,885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415,691,305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24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 45,941,273 | 5,396,999 |
| 合計 | 45,941,273 | 5,396,999 |

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成24年4月17日から平成24年5月10日まで、及び平成24年10月16日から平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.7493円 (7,493円) | 0.8125円 (8,125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 | 64,382 | 4.292 | 276,327.540 | |
| | ROLLS-ROYCE GROUP PLC | 17,987 | 8.770 | 157,745.990 | |
| | REXAM PLC | 64,829 | 4.420 | 286,544.180 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 37,562 | 8.465 | 317,962.330 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C | 1,367,012 | 0.000 | 1,367.010 | |
| | GLAXOSMITHKLINE PLC | 32,840 | 13.690 | 449,579.600 | |
| | RIO TINTO PLC-REG | 4,544 | 30.990 | 140,818.560 | |
| | PEARSON PLC | 17,792 | 12.250 | 217,952.000 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 306,222 | 1.676 | 513,228.070 | |
| | KINGFISHER PLC | 96,692 | 2.837 | 274,315.200 | |
| | RECKITT BENCKISER PLC | 8,303 | 37.740 | 313,355.220 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 50,572 | 6.890 | 348,441.080 | |
| | BRIT AMERICAN TOBACCO PLC | 15,195 | 31.990 | 486,088.050 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 110,951 | 6.009 | 666,704.550 | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S | 31,098 | 21.370 | 664,564.260 | | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | | イギリス・ポンド 5,114,993.640 (646,535,196) | |
| スイス・フラン | | 株 | スイス・フラン | スイス・フラン | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 17,843 | 59.950 | 1,069,687.850 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1,980 | 232.900 | 461,142.000 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 9,721 | 57.450 | 558,471.450 | |
| | GIVAUDAN REG | 351 | 918.000 | 322,218.000 | |
| HOLCIM LTD-REG | 5,974 | 63.850 | 381,439.900 | | |
| スイス・フラン 小計 | | | | スイス・フラン 2,792,959.200 (234,273,417) | |
| 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 | 14,788 | 220.300 | 3,257,796.400 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B | 30,938 | 132.300 | 4,093,097.400 | |
| | SKANSKA AB-B | 16,257 | 103.400 | 1,680,973.800 | |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 22,122 | 145.200 | 3,212,114.400 | | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | | | スウェーデン・クローナ 12,243,982.000 (144,478,987) | |
| 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 | 39,401 | 69.400 | 2,734,429.400 | | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | | | ノルウェー・クローネ 2,734,429.400 (37,899,192) | |
| ユーロ | | 株 | ユーロ | ユーロ | |
| | BAYER AG | 6,823 | 65.720 | 448,407.560 | |
| | SIEMENS AG | 4,029 | 79.700 | 321,111.300 | |
| | E.ON AG | 6,291 | 16.500 | 103,801.500 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE | 7,338 | 64.230 | 471,319.740 | |
| | BASF SE | 8,266 | 63.170 | 522,163.220 | |
| ALLIANZ SE-REG | 5,409 | 93.400 | 505,200.600 | | |

| | | | | |
|--------|------------------------|---------|--------|---------------------------------------|
| | PHILIPS ELECTRONICS NV | 19,740 | 20.060 | 395,984.400 |
| | AHOLD (KONINKLIJKE) NV | 33,866 | 9.712 | 328,906.590 |
| | AKZO NOBEL | 7,962 | 42.110 | 335,279.820 |
| | TOTAL SA | 12,161 | 38.000 | 462,118.000 |
| | SCHNEIDER ELECTRIC SA | 8,571 | 50.090 | 429,321.390 |
| | BNP PARIBAS | 13,271 | 39.455 | 523,607.300 |
| | FRANCE TELECOM SA | 22,174 | 8.302 | 184,088.540 |
| | SANOFI | 9,938 | 68.600 | 681,746.800 |
| | GDF SUEZ | 21,009 | 16.815 | 353,266.330 |
| | TELECOM ITALIA-RNC | 372,869 | 0.611 | 227,822.950 |
| | REPSOL SA | 14,024 | 15.200 | 213,164.800 |
| | OESTERREICHISCHE POST | 12,096 | 29.200 | 353,203.200 |
| ユーロ 小計 | | | | ユーロ 6,860,514.040 (693,803,785) |
| 合計 | | | | 1,756,990,577 [1,756,990,577] |

- (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% | 36.8% |
| スイス・フラン | 株式 5銘柄 | 100% | 13.3% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 4銘柄 | 100% | 8.2% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 1銘柄 | 100% | 2.2% |
| ユーロ | 株式 18銘柄 | 100% | 39.5% |

- 第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ・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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|---------------|---------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 68,596,133 | 77,703,785 |
| コール・ローン | 26,929,088 | 27,507,096 |
| 株式 | 1,773,868,281 | 1,684,292,087 |
| 投資証券 | 30,908,448 | 23,008,832 |
| 未収入金 | 59,922,184 | 21,905,358 |
| 未収配当金 | 3,156,623 | 5,456,219 |
| 流動資産合計 | 1,963,380,757 | 1,839,873,377 |
| 資産合計 | 1,963,380,757 | 1,839,873,377 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 14,292,059 | 18,305,354 |
| 未払解約金 | 10,000,000 | 23,000,000 |
| 流動負債合計 | 24,292,059 | 41,305,354 |
| 負債合計 | 24,292,059 | 41,305,354 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 1,458,867,598 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 257,229,146 | 339,700,425 |
| 元本等合計 | 1,939,088,698 | 1,798,568,023 |
| 純資産合計 | 1,939,088,698 | 1,798,568,023 |
| 負債純資産合計 | 1,963,380,757 | 1,839,873,377 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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 |

| | |
|----------------------------|--|
| | <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、原則として期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>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> |
| 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 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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|----------------|----------------|----------------|
| 1. 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 1,865,258,422円 | 1,681,859,552円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,232,733円 | 4,159,615円 |
| 期中一部解約元本額 | 190,631,603円 | 227,151,569円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ・グローバル好配当株 | 175,604,517円 | 149,767,163円 |
| ファンド(毎月分配型) | | |
| 安定重視ポートフォリオ(奇数 | 74,086,415円 | 65,009,455円 |
| 月分配型) | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 75,498,539円 | 65,627,876円 |
| (奇数月分配型) | | |
| 成長重視ポートフォリオ(奇数 | 935,252,108円 | 819,416,927円 |
| 月分配型) | | |
| 安定重視ポートフォリオ(資産 | 1,376,265円 | - 円 |
| 形成型) | | |
| インカム重視ポートフォリオ | 2,063,205円 | - 円 |
| (資産形成型) | | |
| 成長重視ポートフォリオ(資産 | 20,905,923円 | - 円 |
| 形成型) | | |
| ダイワ・株/債券/コモディ | 167,745,031円 | 156,944,143円 |
| ティ・バランスファンド | | |
| ダイワ資産分散インカムオー | 205,050,704円 | 177,843,533円 |
| ン(奇数月決算型) | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 5,455,607円 | 5,455,607円 |
| (六つの羽/安定コース) | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 9,131,329円 | 8,700,443円 |
| (六つの羽/6分散コース) | | |
| DCダイワ・ワールドアセット | 9,689,909円 | 10,102,451円 |
| (六つの羽/成長コース) | | |
| 計 | 1,681,859,552円 | 1,458,867,598円 |

| | | |
|------------------|----------------|----------------|
| 2. 期末日における受益権の総数 | 1,681,859,552口 | 1,458,867,598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24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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 | 47,484,378 | 4,286,360 |
| 投資証券 | 1,091,264 | 597,632 |
| 合計 | 46,393,114 | 3,688,728 |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年4月17日から平成24年5月10日まで、及び平成24年10月16日から平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1529円 (11,529円) | 1.2329円 (12,329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 | 27,000 | 34.460 | 930,420.000 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM | 8,000 | 34.210 | 273,680.000 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP | 48,000 | 3.930 | 188,640.000 | |
| | WESTPAC BANKING | 30,000 | 25.170 | 755,100.000 | |
| | AUSTRALIA & NZLAND BK | 44,000 | 24.560 | 1,080,640.000 | |
| | RIO TINTO LTD | 3,500 | 58.690 | 205,415.000 | |
| | METCASH LTD | 36,000 | 3.540 | 127,440.000 | |
| | NEWCREST MINING | 12,000 | 26.480 | 317,760.000 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 21,000 | 58.820 | 1,235,220.000 | |
| | ORICA LIMITED | 18,500 | 25.000 | 462,500.000 | |
| | QBE INSURANCE | 14,000 | 12.870 | 180,180.000 | |
| | SEVEN WEST MEDIA LTD | 45,000 | 1.110 | 49,950.000 | |
| | COCA-COLA AMATIL LIMITED | 14,000 | 13.270 | 185,780.000 | |
| | TELSTRA CORPORATION | 133,734 | 4.110 | 549,646.740 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 5,000 | 31.160 | 155,800.000 | |
| | CSL LIMITED | 8,000 | 48.400 | 387,200.000 | |
| | WESFARMERS LIMITED | 17,000 | 34.300 | 583,100.000 | |
| KINGSGATE CONSOLIDATED NL | 10,000 | 5.520 | 55,200.000 | | |
| SUNCORP GROUP LTD | 44,000 | 9.310 | 409,640.000 | | |
| TRANSURBAN GROUP | 45,000 | 6.080 | 273,600.000 | | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | | オーストラリア・ドル 8,406,911.740 (694,663,118) | |
| 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 | 25,000 | 18.300 | 457,500.000 | |
| | KEPPEL CORP | 20,000 | 10.150 | 203,000.000 | |
| | M1 LTD | 160,000 | 2.620 | 419,200.000 | |
| | INDOFOOD AGRI RESOURCES L | 75,000 | 1.230 | 92,250.000 | |
| | OSIM INTERNATIONAL LTD | 400,000 | 1.640 | 656,000.000 | |
| COURTS ASIA LTD | 400,000 | 0.675 | 270,000.000 | | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | | シンガポール・ドル 2,097,950.000 (136,282,832) | |
| 韓国・ウォン | | 株 | 韓国・ウォン | 韓国・ウォン | |
| | KIA MOTORS CORPORATION | 3,500 | 56,600.000 | 198,100,000.000 | |
| | HYUNDAI ENGINEERING & CON | 2,000 | 61,900.000 | 123,800,000.000 | |
| | HYUNDAI MOTOR CO | 1,500 | 214,000.000 | 321,000,000.000 | |
| | POSCO | 200 | 326,500.000 | 65,300,000.000 | |
| WOORI INVESTMENT & SEC | 7,000 | 10,650.000 | 74,550,000.000 | | |

| | | | | |
|-----------|---------------------------|---------|---------------|--|
| | S-OIL CORPORATION | 5,000 | 96,900.000 | 484,500,000.000 |
| | HYUNDAI WIA CORP | 600 | 161,000.000 | 96,600,000.000 |
| | HYUNDAI DEVELOPMENT COMPA | 8,000 | 19,250.000 | 154,000,000.000 |
| | S1 CORPORATION | 2,000 | 66,800.000 | 133,600,000.000 |
| | SAMSUNG ENGINEERING CO LT | 1,500 | 151,000.000 | 226,500,000.000 |
| | KT&G CORP | 1,200 | 83,800.000 | 100,560,000.000 |
| | LG HOUSEHOLD & HEALTH | 650 | 635,000.000 | 412,750,000.000 |
| | LG CHEMICAL LTD | 1,100 | 307,500.000 | 338,250,000.000 |
| | KB FINANCIL GROUP INC | 13,500 | 35,900.000 | 484,650,000.000 |
| | SAMSUNG ELECTRONICS | 1,300 | 1,341,000.000 | 1,743,300,000.000 |
| | HANA FINANCIAL GROUP | 5,000 | 31,550.000 | 157,750,000.000 |
| 韓国・ウォン 小計 | | | | 韓国・ウォン 5,115,210,000.000 (373,921,851) |
| 香港・ドル | | 株 | 香港・ドル | 香港・ドル |
| | CHEUNG KONG | 15,000 | 112.900 | 1,693,500.000 |
| | WHARF HOLDINGS | 25,000 | 52.900 | 1,322,500.000 |
| | HANG SENG BANK | 17,000 | 115.700 | 1,966,900.000 |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 50,000 | 26.850 | 1,342,500.000 |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR | 65,000 | 46.600 | 3,029,000.000 |
| | AIA GROUP LTD | 50,000 | 30.200 | 1,510,000.000 |
| | IND & COMM BK OF CHINA-H | 200,000 | 5.060 | 1,012,000.000 |
| | COUNTRY GARDEN HOLDINGS | 450,000 | 3.350 | 1,507,500.000 |
| | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS | 130,000 | 29.050 | 3,776,500.000 |
| | CHINA NATIONAL BUILDING-H | 50,000 | 10.300 | 515,000.000 |
| 香港・ドル 小計 | | | | 香港・ドル 17,675,400.000 (181,349,604) |
| 台湾・ドル | | 株 | 台湾・ドル | 台湾・ドル |
| | TAIWAN CEMENT | 140,000 | 37.650 | 5,271,000.000 |
| | ORIENTAL UNION CHEMICAL | 110,000 | 33.400 | 3,674,000.000 |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 40,200 | 37.000 | 1,487,400.000 |
| | MEDIATEK INC | 10,000 | 325.000 | 3,250,000.000 |
| | FUBON FINANCIAL HOLDING | 73,495 | 31.850 | 2,340,815.750 |
| | CHINATRUST FINANCIAL HOLD | 380,800 | 15.900 | 6,054,720.000 |
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 8,000 | 706.000 | 5,648,000.000 |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS | 30,000 | 113.000 | 3,390,000.000 |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 40,000 | 100.500 | 4,020,000.000 |
| | TPK HOLDING CO LTD | 20,183 | 430.000 | 8,678,690.000 |
| | MSTAR SEMICONDUCTOR INC | 30,000 | 249.000 | 7,470,000.000 |
| | FAR EASTONE TELECOMM CO L | 220,000 | 66.300 | 14,586,000.000 |
| | RADIANT OPTO-ELECTRONICS | 72,100 | 123.000 | 8,868,300.000 |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 250,000 | 90.800 | 22,700,000.000 |
| | HON HAI PRECISION INDUS | 28,000 | 91.400 | 2,559,200.000 |
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 5,000 | 320.500 | 1,602,500.000 |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY | 74,781 | 30.800 | 2,303,254.800 |
| | UNITED MICROELECTRONICS | 450,000 | 10.850 | 4,882,500.000 |
| 台湾・ドル 小計 | | | | 台湾・ドル 108,786,380.550 (298,074,682) |
| 合計 | | | | 1,684,292,087 [1,684,292,087] |

(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 | シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル | |
| | | CAPITACOMMERCIAL TRUST | 230,000 | 354,200.000 | |
| | シンガポール・ドル 小計 | | | シンガポール・ドル 354,200.000 (23,008,832) | |
| 投資証券 合計 | | | | 23,008,832 [23,008,832] | |
| 合計 | | | | 23,008,832 [23,008,832] | |

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 20銘柄 | 100% | -% | 40.7% |
| シンガポール・ドル | 株式 6銘柄 投資証券 1銘柄 | 85.6% | 14.4% | 9.3% |
| 韓国・ウォン | 株式 16銘柄 | 100% | -% | 21.9% |
| 香港・ドル | 株式 10銘柄 | 100% | -% | 10.6% |
| 台湾・ドル | 株式 18銘柄 | 100% | -% | 17.5% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|------------------|----------------|
| | 金額（円） | 金額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,142,694,241 | 331,696,312 |
| 株式 | 22,489,644,000 | 21,024,897,800 |
| 未収入金 | 147,882,475 | 569,744,703 |
| 未収配当金 | 389,623,764 | 257,253,400 |
| 前払金 | 36,200,000 | - |
| 差入委託証拠金 | 13,200,000 | - |
| 流動資産合計 | 24,219,244,480 | 22,183,592,215 |
| 資産合計 | 24,219,244,480 | 22,183,592,215 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 36,718,642 | - |
| 未払金 | 349,410,488 | 605,441,108 |
| 未払解約金 | 17,500,000 | 43,000,000 |
| 流動負債合計 | 403,629,130 | 648,441,108 |
| 負債合計 | 403,629,130 | 648,441,108 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 21,835,261,116 | 21,305,208,852 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,980,354,234 | 229,942,255 |
| 元本等合計 | 23,815,615,350 | 21,535,151,107 |
| 純資産合計 | 23,815,615,350 | 21,535,151,107 |
| 負債純資産合計 | 24,219,244,480 | 22,183,592,215 |

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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首 | 平成23年11月11日 | 平成24年5月11日 |
| 期首元本額 | 23,819,383,735円 | 21,835,261,116円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,340,168,620円 | 993,581,628円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,324,291,239円 | 1,523,633,892円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ好配当日本株投信Q （FOFs用）（適格機関投資家専用） | 6,426,010,496円 | 7,003,831,235円 |
| ダイワ好配当日本株投信（季節 点描） | 10,183,818,532円 | 9,256,285,377円 |
| ダイワ・バランス2資産（外債 ・好配当日本株）（毎月分配 型） | 30,580,618円 | 29,828,791円 |
| ダイワ・バランス3資産（外債 ・海外リート・好配当日本株） | 90,457,052円 | 94,730,766円 |
| 安定重視ポートフォリオ（奇数 月分配型） | 228,297,870円 | 220,039,939円 |
| インカム重視ポートフォリオ （奇数月分配型） | 236,170,121円 | 212,889,127円 |
| 成長重視ポートフォリオ（奇数 月分配型） | 2,963,833,745円 | 2,815,665,506円 |
| 安定重視ポートフォリオ（資産 形成型） | 4,140,659円 | - 円 |
| インカム重視ポートフォリオ （資産形成型） | 6,752,624円 | - 円 |
| 成長重視ポートフォリオ（資産 形成型） | 66,687,995円 | - 円 |
| ダイワ・株／債券／コモディ ティ・バランスファンド | 532,054,187円 | 530,164,899円 |
| ダイワ資産分散インカムオーブ ン（奇数月決算型） | 660,932,786円 | 649,750,159円 |
| DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース） | 90,660,764円 | 110,876,302円 |
| DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース） | 148,680,948円 | 176,442,680円 |
| DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース） | 166,182,719円 | 204,704,071円 |
| 計 | 21,835,261,116円 | 21,305,208,852円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 21,835,261,116口 | 21,305,208,852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24年5月11日 至 平成24年11月12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。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 平成24年11月12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24年5月10日現在 | | 平成24年11月12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 | 555,115,996 | | 84,304,027 | |
| 合計 | 555,115,996 | | 84,304,027 | |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年4月17日から平成24年5月10日まで、及び平成24年10月16日から平成24年11月12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24年5月10日 現在 | | | | 平成24年11月12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。

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

2. 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24年5月10日現在 | 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.0907円 (10,907円) | 1.0108円 (10,108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 | 29,800 | 2,279 | 67,914,200 | |
| ミライト・ホールディングス | 42,000 | 580 | 24,360,000 | |
| 田辺工業 | 104,900 | 498 | 52,240,200 | |
| 大東建託 | 8,000 | 7,710 | 61,680,000 | |
| 新日本建設 | 596,000 | 173 | 103,108,000 | |
| 積水ハウス | 138,000 | 769 | 106,122,000 | |
| 住友電設 | 1,500 | 705 | 1,057,500 | |
| 協和エクシオ | 225,600 | 760 | 171,456,000 | |
| NECネットエスアイ | 208,600 | 1,452 | 302,887,200 | |
| S Foods | 195,500 | 734 | 143,497,000 | |
| エプロ | 1,000 | 1,165 | 1,165,000 | |
| 東北新社 | 281,700 | 573 | 161,414,100 | |
| KG情報 | 51,100 | 436 | 22,279,600 | |
| ディー・エヌ・エー | 83,000 | 2,596 | 215,468,000 | |
| 一休 | 2,270 | 44,500 | 101,015,000 | |
| WDBホールディングス | 139 | 155,500 | 21,614,500 | |
| コメ兵 | 211,600 | 515 | 108,974,000 | |
| あいホールディングス | 222,600 | 485 | 107,961,000 | |
| 富士紡ホールディングス | 694,000 | 370 | 256,780,000 | |
| サイバー | 99,900 | 372 | 37,162,800 | |
| UKCホールディングス | 306,400 | 1,443 | 442,135,200 | |
| クリヤマホールディングス | 208,900 | 497 | 103,823,300 | |
| 日本バイリン | 252,000 | 342 | 86,184,000 | |
| セーレン | 228,000 | 469 | 106,932,000 | |
| ITホールディングス | 206,200 | 994 | 204,962,800 | |
| リスクモンスター | 4,000 | 444 | 1,776,000 | |
| ニフティ | 948 | 132,400 | 125,515,200 | |
| 東亜合成 | 275,000 | 330 | 90,750,000 | |
| 日本ピグメント | 419,000 | 168 | 70,392,000 | |
| サンエー化研 | 35,400 | 328 | 11,611,200 | |
| セプテーニHLDGS | 3,230 | 67,800 | 218,994,000 | |
| テイクアンドグヴィニーズ | 17,000 | 7,930 | 134,810,000 | |
| 武田薬品 | 24,000 | 3,650 | 87,600,000 | |
| 塩野義製薬 | 200,000 | 1,326 | 265,200,000 | |
| 科研製薬 | 119,000 | 1,253 | 149,107,000 | |

| | | | |
|----------------|-----------|--------|-------------|
| 日本ケミファ | 240,000 | 531 | 127,440,000 |
| キョーリン製薬HD | 150,000 | 1,765 | 264,750,000 |
| ダイト | 118,000 | 1,440 | 169,920,000 |
| エスケー化研 | 1,000 | 3,390 | 3,390,000 |
| 東洋インキSCホールディング | 240,000 | 285 | 68,400,000 |
| 秀英予備校 | 202,300 | 284 | 57,453,200 |
| リソー教育 | 1,000 | 6,150 | 6,150,000 |
| シーエーシー | 254,000 | 662 | 168,148,000 |
| トーセ | 123,000 | 498 | 61,254,000 |
| 日本ハウズイング | 5,800 | 2,080 | 12,064,000 |
| 電通国際情報S | 137,000 | 674 | 92,338,000 |
| 資生堂 | 70,000 | 1,075 | 75,250,000 |
| コニシ | 40,300 | 1,188 | 47,876,400 |
| ケミプロ化成 | 11,000 | 95 | 1,045,000 |
| メック | 193,300 | 214 | 41,366,200 |
| JCU | 26,200 | 2,750 | 72,050,000 |
| 東燃ゼネラル石油 | 301,000 | 703 | 211,603,000 |
| JXホールディングス | 150,000 | 408 | 61,200,000 |
| 東洋ゴム | 320,000 | 198 | 63,360,000 |
| 西川ゴム工業 | 63,000 | 820 | 51,660,000 |
| フコク | 160,300 | 676 | 108,362,800 |
| 旭硝子 | 360,000 | 553 | 199,080,000 |
| 日本ヒューム | 311,000 | 409 | 127,199,000 |
| 三谷セキサン | 200 | 630 | 126,000 |
| ニッカトー | 157,100 | 404 | 63,468,400 |
| クニミネ工業 | 100,000 | 480 | 48,000,000 |
| JFEホールディングス | 120,000 | 1,071 | 128,520,000 |
| 東京鐵鋼 | 250,000 | 262 | 65,500,000 |
| モリ工業 | 590,000 | 211 | 124,490,000 |
| 栗本鉄工所 | 320,000 | 265 | 84,800,000 |
| 川金ホールディングス | 259,600 | 265 | 68,794,000 |
| メタルアート | 1,000 | 221 | 221,000 |
| タツタ電線 | 196,000 | 799 | 156,604,000 |
| オーナンバ | 260,800 | 269 | 70,155,200 |
| 川岸工業 | 230,000 | 170 | 39,100,000 |
| 那須電機 | 237,000 | 221 | 52,377,000 |
| 文化シャツタ- | 427,000 | 339 | 144,753,000 |
| アルインコ | 182,800 | 637 | 116,443,600 |
| ダイニチ工業 | 132,000 | 798 | 105,336,000 |
| 日東精工 | 130,000 | 200 | 26,000,000 |
| 岡部 | 217,400 | 494 | 107,395,600 |
| ジーテクト | 40,700 | 1,558 | 63,410,600 |
| トーアミ | 78,900 | 354 | 27,930,600 |
| パイオラックス | 102,900 | 1,650 | 169,785,000 |
| アイダエンジニア | 191,800 | 495 | 94,941,000 |
| 牧野フライス | 395,000 | 380 | 150,100,000 |
| 高松機械工業 | 56,800 | 424 | 24,083,200 |
| エイチアンドエフ | 161,800 | 820 | 132,676,000 |
| ゲームカード・ジョイコHD | 25,000 | 1,300 | 32,500,000 |
| 藤商事 | 1,062 | 95,600 | 101,527,200 |
| オカダアイヨン | 344,000 | 289 | 99,416,000 |
| フロイント産業 | 154,000 | 993 | 152,922,000 |
| シンニッタン | 1,038,100 | 316 | 328,039,600 |
| 住友精密 | 66,000 | 309 | 20,394,000 |
| 福島工業 | 54,500 | 1,552 | 84,584,000 |

| | | | |
|----------------|-----------|---------|-------------|
| 新晃工業 | 252,800 | 429 | 108,451,200 |
| T P R | 112,000 | 826 | 92,512,000 |
| ニチダイ | 118,800 | 396 | 47,044,800 |
| 放電精密加工研 | 46,700 | 524 | 24,470,800 |
| 山洋電気 | 205,000 | 420 | 86,100,000 |
| デンヨー | 48,000 | 808 | 38,784,000 |
| 愛知電機 | 947,000 | 247 | 233,909,000 |
| M C J | 1,693,000 | 171 | 289,503,000 |
| 日本電気 | 700,000 | 139 | 97,300,000 |
| ナカヨ通信機 | 372,000 | 237 | 88,164,000 |
| ワコム | 770 | 229,700 | 176,869,000 |
| 日本信号 | 181,700 | 433 | 78,676,100 |
| T O A | 175,000 | 561 | 98,175,000 |
| 三社電機製作所 | 444,000 | 301 | 133,644,000 |
| オーデリック | 89,900 | 1,940 | 174,406,000 |
| 遠藤照明 | 86,600 | 3,535 | 306,131,000 |
| 日本デジタル研究所 | 396,700 | 806 | 319,740,200 |
| 芝浦電子 | 66,600 | 855 | 56,943,000 |
| 日本輸送機 | 479,000 | 210 | 100,590,000 |
| トヨタ自動車 | 44,000 | 3,085 | 135,740,000 |
| G M B | 86,400 | 800 | 69,120,000 |
| 新明和工業 | 84,000 | 445 | 37,380,000 |
| 極東開発工業 | 61,000 | 692 | 42,212,000 |
| ユタカ技研 | 400 | 1,290 | 516,000 |
| 自動車部品 | 335,000 | 243 | 81,405,000 |
| 東京ラヂエ - タ - | 353,100 | 290 | 102,399,000 |
| N O K | 146,000 | 1,114 | 162,644,000 |
| 太平洋工業 | 309,100 | 444 | 137,240,400 |
| 今仙電機製作所 | 51,900 | 820 | 42,558,000 |
| 本田技研 | 1,000 | 2,358 | 2,358,000 |
| 富士重工業 | 184,000 | 793 | 145,912,000 |
| T B K | 447,000 | 385 | 172,095,000 |
| 村上開明堂 | 162,000 | 933 | 151,146,000 |
| フジオーゼックス | 180,000 | 299 | 53,820,000 |
| 萩原電気 | 9,600 | 833 | 7,996,800 |
| マルカキカイ | 90,500 | 958 | 86,699,000 |
| アルゴグラフィックス | 31,600 | 1,030 | 32,548,000 |
| マックハウス | 4,300 | 585 | 2,515,500 |
| キヤノン | 50,000 | 2,453 | 122,650,000 |
| リ コ ー | 240,000 | 650 | 156,000,000 |
| ニホンフラッシュ | 106,300 | 1,235 | 131,280,500 |
| 前田工織 | 51,800 | 1,682 | 87,127,600 |
| アートネイチャー | 66,700 | 1,302 | 86,843,400 |
| 萩原工業 | 131,300 | 1,230 | 161,499,000 |
| エイベックス・グループHD | 144,000 | 1,615 | 232,560,000 |
| 藤森工業 | 123,100 | 1,928 | 237,336,800 |
| ニ ッ ピ | 96,000 | 557 | 53,472,000 |
| ピジヨン | 18,000 | 3,550 | 63,900,000 |
| 天馬 | 53,500 | 736 | 39,376,000 |
| イトーキ | 344,000 | 446 | 153,424,000 |
| 三菱商事 | 26,000 | 1,437 | 37,362,000 |
| 三谷商事 | 24,000 | 882 | 21,168,000 |
| フルサト工業 | 58,500 | 693 | 40,540,500 |
| ワ キ タ | 350,000 | 568 | 198,800,000 |
| ヤマトインタ - ナショナル | 48,300 | 347 | 16,760,100 |

| | | | |
|-----------------|-----------|--------|----------------|
| 新光商事 | 118,500 | 650 | 77,025,000 |
| 三菱UFJフィナンシャルG | 1,660,000 | 350 | 581,000,000 |
| 三井住友フィナンシャルG | 318,000 | 2,371 | 753,978,000 |
| 大分銀行 | 680,000 | 264 | 179,520,000 |
| 宮崎銀行 | 572,000 | 189 | 108,108,000 |
| 琉球銀行 | 51,000 | 990 | 50,490,000 |
| 東日本銀行 | 744,000 | 172 | 127,968,000 |
| 極東証券 | 6,800 | 617 | 4,195,600 |
| 第一生命 | 1,520 | 86,400 | 131,328,000 |
| NECキャピタルソリューション | 170,000 | 1,092 | 185,640,000 |
| T&Dホールディングス | 70,000 | 801 | 56,070,000 |
| 京阪神ビルディング | 149,000 | 361 | 53,789,000 |
| フジ住宅 | 58,800 | 402 | 23,637,600 |
| 明和地所 | 300,000 | 338 | 101,400,000 |
| 日本エスリード | 246,400 | 643 | 158,435,200 |
| 日神不動産 | 268,800 | 396 | 106,444,800 |
| リベステ | 1,560 | 49,200 | 76,752,000 |
| サンヨーハウジ 名古屋 | 720 | 81,300 | 58,536,000 |
| フージャースコーポレーション | 1,059 | 58,400 | 61,845,600 |
| ゼロ | 6,900 | 325 | 2,242,500 |
| アルプス物流 | 213,300 | 771 | 164,454,300 |
| ヒューテックノオリン | 222,200 | 800 | 177,760,000 |
| センコー | 232,000 | 319 | 74,008,000 |
| 日本郵船 | 300,000 | 153 | 45,900,000 |
| 川崎近海汽船 | 247,000 | 190 | 46,930,000 |
| 日本航空 | 41,000 | 3,810 | 156,210,000 |
| 東陽倉庫 | 495,000 | 174 | 86,130,000 |
| イヌイ倉庫 | 116,000 | 411 | 47,676,000 |
| 日本電信電話 | 30,000 | 3,660 | 109,800,000 |
| KDDI | 96,000 | 6,060 | 581,760,000 |
| 光通信 | 26,000 | 4,280 | 111,280,000 |
| ゼンリン | 42,000 | 989 | 41,538,000 |
| 沖縄電力 | 8,100 | 2,385 | 19,318,500 |
| 東京瓦斯 | 340,000 | 408 | 138,720,000 |
| 北海道瓦斯 | 258,000 | 223 | 57,534,000 |
| AOI Pro. | 151,500 | 553 | 83,779,500 |
| シーイーシー | 149,600 | 443 | 66,272,800 |
| 西尾レントオール | 129,000 | 967 | 124,743,000 |
| SCSK | 224,000 | 1,363 | 305,312,000 |
| メイテック | 36,000 | 1,837 | 66,132,000 |
| 富士ソフト | 69,500 | 1,692 | 117,594,000 |
| 東海リース | 302,000 | 166 | 50,132,000 |
| ステップ | 137,000 | 648 | 88,776,000 |
| 日立機材 | 374,400 | 501 | 187,574,400 |
| バイテック | 87,500 | 558 | 48,825,000 |
| ジェコス | 110,900 | 511 | 56,669,900 |
| やまや | 68,500 | 1,024 | 70,144,000 |
| 合計 | | | 21,024,897,800 |

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

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24年5月11日から平成24年11月12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）】

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】

（単位：円）

| | 前 期 平成24年5月10日現在 | 当 期 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 24,530,740 | 20,732,955 |
| 親投資信託受益証券 | 2,617,029,973 | 2,203,663,990 |
| 未収入金 | 22,000,000 | 21,500,000 |
| 流動資産合計 | 2,663,560,713 | 2,245,896,945 |
| 資産合計 | | |
| | 2,663,560,713 | 2,245,896,945 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 20,301,732 | 17,055,239 |
| 未払解約金 | 1,758,065 | 4,348,465 |
| 未払受託者報酬 | 235,112 | 207,428 |
| 未払委託者報酬 | 5,760,634 | 5,082,173 |
| その他未払費用 | 110,180 | 94,738 |
| 流動負債合計 | 28,165,723 | 26,788,043 |
| 負債合計 | | |
| | 28,165,723 | 26,788,043 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ₁ 4,060,346,480 | ₁ 3,411,047,921 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | ₂ 1,424,951,490 | ₂ 1,191,939,019 |
| （分配準備積立金） | 62,071,823 | 40,964,120 |
| 元本等合計 | 2,635,394,990 | 2,219,108,902 |
| 純資産合計 | | |
| | 2,635,394,990 | 2,219,108,902 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 2,663,560,713 | 2,245,896,945 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 前 期 自 平成23年11月11日 至 平成24年5月10日 | 当 期 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12日 |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 10,771 | 9,140 |
| 有価証券売買等損益 | 169,325,551 | 71,134,017 |
| 営業収益合計 | 169,336,322 | 71,143,157 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 735,115 | 632,203 |
| 委託者報酬 | ₁ 18,011,623 | ₁ 15,489,842 |
| その他費用 | 110,180 | 94,738 |
| 営業費用合計 | 18,856,918 | 16,216,783 |
| 営業利益 | 150,479,404 | 54,926,374 |
| 経常利益 | 150,479,404 | 54,926,374 |
| 当期純利益 | 150,479,404 | 54,926,374 |
| 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（ ） | 5,644,420 | 1,501,563 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,720,148,873 | 1,424,951,490 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 245,136,497 | 235,502,645 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 245,136,497 | 235,502,645 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 9,124,415 | 5,208,063 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 9,124,415 | 5,208,063 |
| 分配金 | ₂ 85,649,683 | ₂ 53,710,048 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,424,951,490 | 1,191,939,019 |

(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24年5月11日 至平成24年11月12日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日 平成24年11月10日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成24年11月12日としております。このため、当特定期間は186日となっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前期 平成24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額 | 4,705,524,068円 | 4,060,346,480円 |
| 期中追加設定元本額 | 25,529,761円 | 14,620,571円 |
| 期中一部解約元本額 | 670,707,349円 | 663,919,130円 |
| 2. 特定期間末日における受益権の総数 | 4,060,346,480口 | 3,411,047,921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1,424,951,490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1,191,939,019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11月11日 至平成24年5月10日 | 当期 自平成24年5月11日 至平成24年11月12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 | 710,176円 | 624,083円 |

2. 2 分配金の計算過程

（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。

（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（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。

（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（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。

（自平成24年5月11日 至平成24年7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（11,908,064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（317,663円）及び分配準備積立金（56,889,223円）より分配対象額は69,114,950円（1万口当たり185.47円）であり、うち18,632,314円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成24年7月11日 至平成24年9月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,210,127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（370,387円）及び分配準備積立金（48,462,481円）より分配対象額は63,042,995円（1万口当たり174.90円）であり、うち18,022,495円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（自平成24年9月11日 至平成24年11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（15,818,551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（406,258円）及び分配準備積立金（42,200,808円）より分配対象額は58,425,617円（1万口当たり171.28円）であり、うち17,055,239円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（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 | 当期 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12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 | 74,655,392 | 48,163,706 |
| 合計 | 74,655,392 | 48,163,706 |

（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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.6491円 (6,491円) | 0.6506円 (6,506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 | 1,282,718,754 | 1,558,375,014 | |
| | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 106,204,473 | 105,864,618 | |
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド | 212,889,127 | 215,188,329 | |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 71,661,640 | 68,630,352 | |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 84,966,684 | 69,035,430 | |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 65,627,876 | 80,912,608 | |
| | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 95,921,597 | 105,657,639 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 2,203,663,990 | |
| 合計 | | | 2,203,663,990 | |

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成24年5月11日から平成24年11月12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）】

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

| | 前 期 平成24年5月10日現在 | 当 期 平成24年11月12日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 85,203,175 | 71,743,567 |
| 親投資信託受益証券 | 9,187,208,197 | 8,166,206,985 |
| 未収入金 | 73,000,000 | 72,000,000 |
| 流動資産合計 | 9,345,411,372 | 8,309,950,552 |
| 資産合計 | | |
| 9,345,411,372 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 62,524,688 | 56,469,803 |
| 未払解約金 | 9,401,273 | 10,185,574 |
| 未払受託者報酬 | 837,972 | 768,853 |
| 未払委託者報酬 | 21,787,966 | 19,990,733 |
| その他未払費用 | 378,673 | 345,979 |
| 流動負債合計 | 94,930,572 | 87,760,942 |
| 負債合計 | | |
| 94,930,572 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 15,631,172,119 | 14,117,450,844 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 6,380,691,319 | 5,895,261,234 |
| （分配準備積立金） | 858,282,372 | 717,930,213 |
| 元本等合計 | 9,250,480,800 | 8,222,189,610 |
| 純資産合計 | | |
| 9,250,480,800 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 9,345,411,372 | | |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 前期 | | 当期 | |
|---|-------------------------------|--------------------------|-------------------------------|--------------------------|
| | 自 平成23年11月11日 至 平成24年5月10日 | | 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12日 | |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 36,299 | | 32,882 |
| 有価証券売買等損益 | | 935,741,029 | | 87,998,788 |
| 営業収益合計 | | 935,777,328 | | 88,031,670 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 2,525,024 | | 2,307,162 |
| 委託者報酬 | | ₁ 65,652,127 | | ₁ 59,987,324 |
| その他費用 | | 378,673 | | 345,979 |
| 営業費用合計 | | 68,555,824 | | 62,640,465 |
| 営業利益 | | 867,221,504 | | 25,391,205 |
| 経常利益 | | 867,221,504 | | 25,391,205 |
| 当期純利益 | | 867,221,504 | | 25,391,205 |
| 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（ ） | | 23,929,195 | | 1,714,730 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 7,903,303,689 | | 6,380,691,319 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 897,985,180 | | 656,910,495 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 897,985,180 | | 656,910,495 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 23,508,119 | | 22,370,826 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 23,508,119 | | 22,370,826 |
| 分配金 | | ₂ 195,157,000 | | ₂ 176,215,519 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 6,380,691,319 | | 5,895,261,234 |

(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24年5月11日 至平成24年11月12日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 特定期間末日 平成24年11月10日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成24年11月12日としております。このため、当特定期間は186日となっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 前期 平成24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額 | 17,654,819,802円 | 15,631,172,119円 |
| 期中追加設定元本額 | 55,178,530円 | 53,311,081円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,078,826,213円 | 1,567,032,356円 |
| 2. 特定期間末日における受益権の総数 | 15,631,172,119口 | 14,117,450,844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6,380,691,319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5,895,261,234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11月11日 至平成24年5月10日 | 当期 自平成24年5月11日 至平成24年11月12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 | 6,461,175円 | 5,944,214円 |

2. 2 分配金の計算過程

（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。

（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（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。

（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（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。

（自平成24年5月11日 至平成24年7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（29,028,218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（639,537,703円）及び分配準備積立金（833,860,184円）より分配対象額は1,502,426,105円（1万口当たり988.18円）であり、うち60,815,667円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

（自平成24年7月11日 至平成24年9月10日）
 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（34,402,097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（620,572,868円）及び分配準備積立金（776,345,435円）より分配対象額は1,431,320,400円（1万口当たり971.54円）であり、うち58,930,049円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

（自平成24年9月11日 至平成24年11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（54,886,493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（595,588,912円）及び分配準備積立金（719,513,523円）より分配対象額は1,369,988,928円（1万口当たり970.42円）であり、うち56,469,803円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

（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 | 当期 自 平成24年5月11日 至 平成24年11月12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11月12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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12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 | 381,199,409 | 144,199,877 |
| 合計 | 381,199,409 | 144,199,877 |

（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24年5月10日現在 | 当期 平成24年11月12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24年5月11日 至 平成24年11月12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24年5月10日現在 | 当 期 平成24年11月12日現在 |
|---------------------------|---------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.5918円 (5,918円) | 0.5824円 (5,824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 | 1,356,466,596 | 1,647,971,267 | |
| | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 395,805,924 | 394,539,345 | |
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド | 2,815,665,506 | 2,846,074,693 | |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 976,863,946 | 935,542,601 | |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 1,154,155,674 | 937,751,485 | |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 819,416,927 | 1,010,259,129 | |
| | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 357,756,210 | 394,068,465 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 8,166,206,985 | |
| 合計 | | | 8,166,206,985 | |

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ」- REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

平成24年11月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 2,352,308,494円 |
| 負債総額 | 8,356,584円 |
| 純資産総額（ - ） | 2,343,951,910円 |
| 発行済数量 | 3,023,530,504口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 0.7752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11月30日

| | |
|------------------|-----------------|
| 資産総額 | 75,830,654,862円 |
| 負債総額 | 1,063,606,964円 |
| 純資産総額（ - ） | 74,767,047,898円 |
| 発行済数量 | 58,861,472,955口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.2702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11月30日

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 307,189,588,099円 |
| 負債総額 | 597,577,745円 |
| 純資産総額（ - ） | 306,592,010,354円 |
| 発行済数量 | 263,973,117,397口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.1615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11月30日

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 206,167,739,289円 |
| 負債総額 | 1,843,027,147円 |
| 純資産総額（ - ） | 204,324,712,142円 |
| 発行済数量 | 195,332,760,127口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.0460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11月30日

| | |
|------------------|-----------------|
| 資産総額 | 12,175,975,601円 |
| 負債総額 | 68,514,077円 |
| 純資産総額（ - ） | 12,107,461,524円 |
| 発行済数量 | 10,559,547,229口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.1466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11月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 2,081,024,278円 |
| 負債総額 | 21,358,067円 |
| 純資産総額（ - ） | 2,059,666,211円 |
| 発行済数量 | 2,047,357,055口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.0060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11月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 1,925,571,600円 |
| 負債総額 | 13,008,641円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,912,562,959円 |
| 発行済数量 | 2,197,500,934口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 0.8703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11月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 1,879,391,864円 |
| 負債総額 | 29,197,452円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,850,194,412円 |
| 発行済数量 | 1,414,665,481口 |
| 1 単位当たり純資産額（ / ） | 1.3079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11月30日

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 22,768,252,180円 |
| 負債総額 | 142,817,236円 |
| 純資産総額（ - ） | 22,625,434,944円 |
| 発行済数量 | 21,082,263,258口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.0732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11月30日

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 2,294,901,696円 |
| 負債総額 | 7,948,655円 |
| 純資産総額（ - ） | 2,286,953,041円 |
| 発行済数量 | 3,355,723,346口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 0.6815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11月30日

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 8,593,839,401円 |
| 負債総額 | 53,160,144円 |
| 純資産総額（ - ） | 8,540,679,257円 |
| 発行済数量 | 13,894,463,586口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 0.6147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4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成24年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格 | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託 | 5 | 90,504 |
| 追加型株式投資信託 | 418 | 6,982,622 |
| 株式投資信託 合計 | 423 | 7,073,126 |
| 単位型公社債投資信託 | - | - |
| 追加型公社債投資信託 | 17 | 2,403,612 |
| 公社債投資信託 合計 | 17 | 2,403,612 |
| 総合計 | 440 | 9,476,738 |

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第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、第53期事業年度（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。

また、第54期事業年度に係る中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、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 |
| 建物（純額） | 967,190 | 1,003,450 |
| 器具備品（純額） | 332,407 | 513,162 |
| 建設仮勘定 | 634,782 | 484,571 |
| | - | 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 |

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

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 その他有価証券 | 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 その他有価証券 | 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・マーケッツ㈱ | 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。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

| | | 当中間会計期間末 (平成24年9月30日) |
|------------|---|--------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | | 1,833,296 |
| 有価証券 | | 16,491,682 |
| 未収委託者報酬 | | 6,074,374 |
| 貯蔵品 | | 9,897 |
| 繰延税金資産 | | 576,334 |
| その他 | | 421,905 |
| 流動資産計 | | 25,407,491 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 812,139 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | | 2,304,771 |
| その他 | | 710,794 |
| 無形固定資産合計 | | 3,015,566 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 13,513,781 |
| その他 | 1 | 2,247,303 |
| 貸倒引当金 | | 9,950 |
| 投資その他の資産合計 | | 15,751,135 |
| 固定資産計 | | 19,578,842 |
| 資産合計 | | 44,986,333 |

(単位:千円)

| | | 当中間会計期間末 (平成24年9月30日) |
|-------------|---|--------------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | | 4,702,038 |
| 未払費用 | | 3,673,584 |
| 未払法人税等 | | 743,636 |
| 賞与引当金 | | 426,400 |
| 本社移転関連費用引当金 | | 346,425 |
| 資産除去債務 | | 292,000 |
| その他 | 3 | 270,950 |
| 流動負債計 | | 10,455,035 |
| 固定負債 | | |
| 繰延税金負債 | | 1,465,584 |
| 退職給付引当金 | | 1,864,115 |
| 役員退職慰労引当金 | | 47,925 |

| | |
|--------------|------------|
| 固定負債計 | 3,377,624 |
| 負債合計 | 13,832,659 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 15,174,272 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 11,495,727 |
| 資本剰余金合計 | 11,495,727 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 374,297 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 4,314,536 |
| 利益剰余金合計 | 4,688,834 |
| 株主資本合計 | 31,358,834 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 408,812 |
| 繰延ヘッジ損益 | 203,652 |
| 評価・換算差額等合計 | 205,160 |
| 純資産合計 | 31,153,673 |
| 負債・純資産合計 | 44,986,333 |

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

| | 当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) | |
|--------------|--|------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 35,929,057 |
| その他営業収益 | | 221,982 |
| 営業収益計 | | 36,151,039 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | | 20,053,264 |
| その他営業費用 | | 5,549,289 |
| 営業費用計 | | 25,602,554 |
| 一般管理費 | 1 | 5,244,843 |
| 営業利益 | | 5,303,641 |
| 営業外収益 | 2 | 410,550 |
| 営業外費用 | 1, 3 | 62,244 |
| 経常利益 | | 5,651,948 |
| 特別利益 | | 39,827 |
| 特別損失 | | 14,428 |
| 税引前中間純利益 | | 5,677,347 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 2,153,585 |
| 法人税等調整額 | | 97,806 |
| 中間純利益 | | 3,621,569 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

| | 当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日) |
|-----------|---|
| 株主資本 | |
| 資本金 | |
| 当期首残高 | 15,174,272 |
| 当中間期変動額 | |
| 当中間期変動額合計 | - |
| 当中間期末残高 | 15,174,272 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | |
| 当期首残高 | 11,495,727 |
| 当中間期変動額 | |
| 当中間期変動額合計 | - |
| 当中間期末残高 | 11,495,727 |
| 資本剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 11,495,727 |
| 当中間期変動額 | |
| 当中間期変動額合計 | - |
| 当中間期末残高 | 11,495,727 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | |
| 当期首残高 | 374,297 |
| 当中間期変動額 | |
| 当中間期変動額合計 | - |
| 当中間期末残高 | 374,297 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 7,715,116 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 7,022,149 |
| 中間純利益 | 3,621,569 |
| 当中間期変動額合計 | 3,400,580 |
| 当中間期末残高 | 4,314,536 |

(単位:千円)

| | 当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日) |
|---------|---|
| 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 8,089,414 |
| 当中間期変動額 | |

| | |
|---------------------------|------------|
| 剰余金の配当 | 7,022,149 |
| 中間純利益 | 3,621,569 |
| 当中間期変動額合計 | 3,400,580 |
| 当中間期末残高 | 4,688,834 |
| 株主資本合計 | |
| 当期首残高 | 34,759,414 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 7,022,149 |
| 中間純利益 | 3,621,569 |
| 当中間期変動額合計 | 3,400,580 |
| 当中間期末残高 | 31,358,834 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | |
| 当期首残高 | 33,879 |
| 当中間期変動額 | |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | 442,692 |
| 当中間期変動額合計 | 442,692 |
| 当中間期末残高 | 408,812 |
| 繰延ヘッジ損益 | |
| 当期首残高 | 53,783 |
| 当中間期変動額 | |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | 149,868 |
| 当中間期変動額合計 | 149,868 |
| 当中間期末残高 | 203,652 |
| 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 87,663 |
| 当中間期変動額 | |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | 292,823 |
| 当中間期変動額合計 | 292,823 |
| 当中間期末残高 | 205,160 |
| 純資産合計 | |
| 当期首残高 | 34,847,077 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 7,022,149 |
| 中間純利益 | 3,621,569 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | 292,823 |
| 当中間期変動額合計 | 3,693,404 |
| 当中間期末残高 | 31,153,673 |

重要な会計方針

| | 当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日) |
|----------------------|---|
| 1. 資産の評価基準及び 評価方法 | <p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部 純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算 定）を採用しております。 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。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法により計上しております。</p> |
| 2. 固定資産の減価償却 の方法 | <p>(1) 有形固定資産及び投資不動産 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</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能 期間（5年）に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p> |
| 3. 引当金の計上基準 | <p>(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率 法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評 価法により計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会 計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中 間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金 は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績 等に応じて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中 間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規 程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(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。</p> |

| | |
|-----------------------------|--|
| 4．ヘッジ会計の方法 | <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p> |
| 5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p> |

会計方針の変更等

| |
|--|
| <p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p> |
| <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4月 1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。</p> |

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| | |
|--|----------------------------------|
| <p>当中間会計期間末 (平成24年 9月30日)</p> | |
| <p>1．減価償却累計額 有形固定資産 投資その他の資産</p> | <p>3,428,406千円 741,362千円</p> |
| <p>2．債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,329,090千円に対して保証を行っております。</p> | |
| <p>3．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。</p> | |

(中間損益計算書関係)

| | |
|--|--|
| <p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p> | |
| <p>1．減価償却累計額</p> | |

| | |
|---------------|-----------|
| 有形固定資産 | 207,578千円 |
| 無形固定資産 | 440,371千円 |
| 投資その他の資産 | 7,190千円 |
| 2. 営業外収益の主要項目 | |
| 受取配当金 | 219,419千円 |
| 投資有価証券売却益 | 90,397千円 |
| 有価証券償還益 | 64,318千円 |
| 3. 営業外費用の主要項目 | |
| 有価証券償還損 | 35,545千円 |
| 投資不動産管理費用 | 7,903千円 |
| 投資不動産償却費 | 6,376千円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数（千株） | 当中間会計期間 増加株式数（千株） | 当中間会計期間 減少株式数（千株） | 当中間会計期間末 株式数（千株） |
|-------|--------------------|----------------------|----------------------|---------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 2,608 | - | - | 2,608 |
| 合計 | 2,608 | - | - | 2,608 |

2. 配当に関する事項

配当金支払額

| （決議） | 株式の種類 | 配当金の総額 （百万円） | 1株当たり 配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成24年6月25日 定時株主総会 | 普通株式 | 7,022 | 2,692 | 平成24年 3月31日 | 平成24年 6月26日 |

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変

動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払金は主に投資信託の販売に係る手数料及び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。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「4.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

() デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2.金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(<注2>参照のこと)。

(単位：千円)

| | 中間貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------------|----------------|------------|----|
| (1) 現金・預金 | 1,833,296 | 1,833,296 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 6,074,374 | 6,074,374 | - |
| (3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 23,805,225 | 23,805,225 | - |

| | | | |
|------------------|------------|------------|---|
| 資産計 | 31,712,896 | 31,712,896 | - |
| (1) 未払金 | 4,702,038 | 4,702,038 | - |
| (2) 未払費用(*1) | 2,991,665 | 2,991,665 | - |
| 負債計 | 7,693,704 | 7,693,704 | - |
| デリバティブ取引(*2) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | - | - | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (2,304) | (2,304) | - |
| デリバティブ取引計 | (2,304) | (2,304) | - |

(*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) 未払金、及び(2) 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 | 中間貸借対照表計上額 |
|---------|------------|
| 非上場株式 | 1,059,169 |
| 子会社株式 | 5,141,069 |
| 長期差入保証金 | 1,587,878 |

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|---------------------------------------|-----------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金 | 1,833,296 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 6,074,374 | - | - | - |
| 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 | 267,222 | 1,676,395 | 3,587,421 | - |
| 合計 | 8,174,892 | 1,676,395 | 3,587,421 | - |

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 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

| | 中間貸借対照表 計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|------------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの | | | |
| 証券投資信託の受益証券 | 2,985,292 | 2,807,373 | 177,919 |
| 小計 | 2,985,292 | 2,807,373 | 177,919 |
| 中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの | | | |
| 株式 | 31,019 | 55,101 | 24,082 |
| 証券投資信託の受益証券 | 20,788,914 | 21,578,724 | 789,810 |
| 小計 | 20,819,933 | 21,633,826 | 813,892 |
| 合計 | 23,805,225 | 24,441,199 | 635,973 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,059,169千円）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。

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

（単位：千円）

| ヘッジ 会計の 方法 | デリバティブ 取引の種類等 | 主な ヘッジ 対象 | 契約額等 | | 時価 | 当該時価の 算定方法 |
|------------------|---------------------------|-----------------|-----------|-------|-------|-----------------------------|
| | | | | うち1年超 | | |
| 原則的 処理方 法 | 株価指数先物取引 売建 TOPIX先物 | 投資 有価証券 | 1,408,896 | - | 2,304 | 東京証券取引所から公表された価格 によっている。 |
| 合計 | | | 1,408,896 | - | 2,304 | |

（資産除去債務関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

使用見込期間を平成23年12月から平成24年12月までの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

| 変動の内容 | 金額 |
|------------|-----------|
| 期首残高 | 292,000千円 |
| 時の経過による調整額 | - |
| 中間期末残高 | 292,000千円 |

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であるため記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、

記載を省略しております。

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

| 当中間会計期間 （自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日） | |
|--|------------|
| 1株当たり純資産額 | 11,943.02円 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 1,388.35円 |
| (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間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。 | |
| 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。 | |
| 中間純利益(千円) | 3,621,569 |
| 普通株式に係る中間純利益(千円) | 3,621,569 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 2,608,525 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

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】

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。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しております。

委託会社は、奈良証券株式会社の株式を250,000株所有しております。

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を207,750株所有しております。

<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。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・ 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・ 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
 - 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ・ 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ・ 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- 次の事項を記載することがあります。
- ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ファンドの形態等を記載することがあります。
- 図案を採用することがあります。
- ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用することがあります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成24年12月7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24年5月11日から平成24年11月12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11月12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12月7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24年5月11日から平成24年11月12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11月12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12月7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24年5月11日から平成24年11月12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11月12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。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月29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、「委託会社等の経理の状況」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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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